

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 15 de septiembre de 2017 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1397.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	272.1	222.3	74.5	151.5	52.8	25.6	95.0
15-35	378.9	443.7	203.5	103.7	38.2	73.2	202.0
36-60	88.1	92.0	0.0	0.0	92.0	88.1	0.0
61-90	19.6	44.2	15.0	0.0	11.2	1.6	18.0
91-180	49.7	72.8	10.0	0.0	24.8	11.7	38.0
>180	37.0	55.1	20.0	10.0	10.1	2.0	25.0
Total	845.4	930.2	323.0	265.2	229.1	202.2	378.0

* Cifras en millones de dólares

** Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.4 %	4.9 %	4.3 %	4.6 %
15-35	4.5 %	4.5 %	3.8 %	4.3 %
36-60	-	4.5 %	4.4 %	4.5 %
61-90	4.2 %	4.3 %	3.8 %	4.3 %
91-180	4.2 %	4.4 %	3.9 %	4.2 %
>180	3.9 %	4.0 %	3.9 %	3.9 %
Total	4.4 %	4.6 %	4.1 %	4.4 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	136	4435	4239	16	155	4995	4375	17	144	3786	4037
Intragruppo y off-shore***	0	0	2017	1640	0	0	2421	2415	0	0	1522	1163
Otros	136	19	1047	1620	155	16	688	1314	144	17	1059	1167
Total	154	154	7499	7499	171	171	8104	8104	161	161	6367	6367

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

** Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.