

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 25 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\$1579.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	256.3	326.2	214.0	133.2	16.2	27.1	96.0
15-35	588.8	444.8	208.3	177.5	58.6	233.3	178.0
36-60	75.7	18.9	0.0	0.0	8.9	65.7	10.0
61-90	38.7	30.5	0.0	0.0	5.5	13.7	25.0
91-180	35.7	63.0	18.1	20.0	29.9	0.7	15.0
>180	12.8	12.3	0.0	10.0	12.3	2.8	0.0
Total	1007.9	895.7	440.4	340.7	131.3	343.2	324.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.5 %	4.7 %	4.2 %	4.5 %
15-35	4.6 %	4.5 %	4.3 %	4.4 %
36-60	4.3 %	4.5 %	4.2 %	4.3 %
61-90	4.2 %	4.4 %	3.7 %	4.1 %
91-180	3.9 %	4.1 %	3.9 %	4.0 %
>180	-	4.0 %	3.7 %	3.8 %
Total	4.5 %	4.5 %	4.2 %	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	25 al 29 de septiembre				2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	153	5586	5325	21	158	4358	4653	4	106	3611	3457
Intragrupo y off-shore***	0	0	2427	2492	0	0	1910	950	0	0	1526	994
Otros	153	23	1130	1326	158	21	917	1582	106	4	802	1488
Total	176	176	9143	9143	179	179	7185	7185	110	110	5939	5939

* 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 intragrupo.