

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 26 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\$1735.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	220.3	182.6	51.7	83.5	24.8	30.8	106.0
15-35	600.1	533.3	247.2	206.8	131.6	238.9	154.5
36-60	202.1	120.7	20.0	0.0	70.7	172.1	30.0
61-90	3.2	29.1	0.0	0.0	29.1	3.2	0.0
91-180	10.1	30.9	13.0	10.0	17.9	0.1	0.0
>180	31.9	61.9	53.0	30.0	8.9	1.9	0.0
Total	1067.7	958.4	384.9	330.3	283.0	447.0	290.5

* 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	5.0 %	4.9 %	3.8 %	4.4 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.4 %	4.6 %
36-60	4.3 %	4.4 %	4.3 %	4.3 %
61-90	-	4.4 %	4.2 %	4.4 %
91-180	-	4.3 %	4.0 %	4.2 %
>180	-	3.8 %	3.9 %	3.8 %
Total	4.7 %	4.6 %	4.3 %	4.5 %

*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**	24	153	5664	5373	20	159	4459	4770	4	105	3706	3525
Intragrupo y off-shore***	0	0	2434	2539	0	0	1955	985	0	0	1526	996
Otros	153	24	1141	1328	159	20	928	1586	105	4	855	1565
Total	177	177	9240	9240	180	180	7341	7341	110	110	6086	6086

* 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.