

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2017

Fecha de Información: 28 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\$1468.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.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	241.5	168.7	118.3	172.5	5.5	24.0	45.0
15-35	641.5	481.8	185.1	285.8	165.0	224.0	131.8
36-60	8.0	6.1	0.0	0.0	6.1	8.0	0.0
61-90	5.5	27.8	14.2	0.0	13.6	5.5	0.0
91-180	0.4	41.3	30.0	0.0	11.3	0.4	0.0
>180	2.0	20.9	20.0	0.0	0.9	2.0	0.0
Total	898.8	746.7	367.5	458.3	202.5	263.8	176.8

* 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	3.5 %	4.3 %	4.2 %	4.1 %
15-35	4.7 %	5.0 %	4.5 %	4.7 %
36-60	-	4.5 %	4.3 %	4.4 %
61-90	-	4.3 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.0 %	4.0 %	4.0 %
>180	-	3.7 %	3.5 %	3.6 %
Total	4.4 %	4.6 %	4.4 %	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**	32	152	6036	5448	26	157	4599	4971	8	106	4013	3768
Intragruppo y off-shore***	0	0	2444	2857	0	0	2074	1056	0	0	1561	1086
Otros	152	32	1160	1335	157	26	985	1630	106	8	939	1659
Total	184	184	9639	9639	184	184	7658	7658	114	114	6513	6513

* 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.