

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 07 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\$1490.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	320.6	196.8	96.0	218.0	49.8	51.6	51.0
15-35	334.5	595.6	354.5	86.5	52.4	59.3	188.7
36-60	59.6	48.3	0.0	0.0	48.3	59.6	0.0
61-90	12.2	33.8	2.0	0.0	26.8	7.2	5.0
91-180	56.1	32.1	0.0	55.0	32.1	1.1	0.0
>180	30.0	45.4	0.0	0.0	15.4	0.0	30.0
Total	813.0	952.1	452.5	359.5	224.9	178.8	274.7

* 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	4.9 %	5.1 %	4.7 %	4.8 %
15-35	4.9 %	5.0 %	4.7 %	4.9 %
36-60	-	5.0 %	4.8 %	4.9 %
61-90	4.4 %	5.0 %	4.3 %	4.8 %
91-180	-	4.7 %	4.3 %	4.5 %
>180	4.2 %	4.6 %	-	4.3 %
Total	4.8 %	5.0 %	4.7 %	4.8 %

*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

Sector	4 al 8 de septiembre				11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	99	4870	4537	18	142	4357	3839	9	171	3334	3438
Intragrupa y off-shore***	0	0	2050	1548	0	0	1876	1909	0	0	1905	1167
Otros	99	27	928	1764	142	18	1033	1519	171	9	594	1229
Total	125	125	7849	7849	160	160	7266	7266	179	179	5834	5834

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo}) - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.