

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 08 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\$1610.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	250.8	314.2	135.0	30.0	29.2	70.8	150.0
15-35	689.1	550.7	149.7	169.5	144.0	262.6	257.0
36-60	0.4	11.7	0.0	0.0	11.7	0.4	0.0
61-90	63.7	65.5	0.0	10.0	12.5	0.7	53.0
91-180	77.8	19.2	0.0	75.0	19.2	2.8	0.0
>180	20.0	16.8	0.0	10.0	6.8	0.0	10.0
Total	1101.8	978.2	284.7	294.5	223.5	337.3	470.0

* 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	5.1 %	4.8 %	4.7 %	4.9 %
15-35	4.8 %	4.8 %	4.7 %	4.7 %
36-60	-	5.3 %	4.3 %	5.3 %
61-90	4.3 %	5.2 %	4.4 %	4.5 %
91-180	-	4.8 %	4.3 %	4.4 %
>180	4.1 %	4.4 %	4.1 %	4.2 %
Total	4.8 %	4.9 %	4.6 %	4.7 %

*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	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	98	4870	4537	18	140	4528	3968	10	151	3413	3613
Intragruppo y off-shore***	0	0	2050	1548	0	0	1908	1916	0	0	2008	1190
Otros	98	27	929	1764	140	18	1031	1583	151	10	616	1235
Total	124	124	7850	7850	158	158	7467	7467	161	161	6037	6037

* 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.