

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 12 de septiembre de 2017¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1654.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	284.1	270.4	119.9	145.4	38.5	26.6	112.0
15-35	416.8	500.0	228.4	92.6	138.5	191.1	133.1
36-60	159.3	126.4	0.0	0.0	106.4	139.3	20.0
61-90	33.2	11.7	0.0	0.0	11.7	33.2	0.0
91-180	40.2	18.8	0.0	40.0	18.8	0.2	0.0
>180	20.0	39.0	21.0	10.0	18.0	10.0	0.0
Total	953.6	966.2	369.3	288.0	331.8	400.5	265.1

* 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	
3-14	4.7 %	4.6 %	4.6 %	4.7 %
15-35	4.6 %	5.0 %	4.4 %	4.7 %
36-60	4.5 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
61-90	-	4.8 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.4 %	4.2 %	4.3 %
>180	-	4.1 %	4.0 %	4.1 %
Total	4.6 %	4.8 %	4.5 %	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	11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	141	4393	4188	13	153	4109	3860	16	143	3532	3818
Intragrupo y off-shore***	0	0	2005	1613	0	0	2101	1779	0	0	1518	1091
Otros	141	18	1023	1620	153	13	684	1255	143	16	972	1114
Total	159	159	7421	7421	166	166	6895	6895	159	159	6022	6022

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