

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 18 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\$1653.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.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	329.5	315.7	138.7	128.5	4.0	28.0	173.0
15-35	506.3	637.4	414.8	181.0	11.7	114.4	210.9
36-60	44.8	41.4	0.0	10.0	31.4	24.8	10.0
61-90	0.6	7.1	0.0	0.0	7.1	0.6	0.0
91-180	62.8	74.1	40.0	50.0	24.1	2.8	10.0
>180	5.0	37.5	30.0	0.0	2.5	0.0	5.0
Total	949.1	1113.1	623.5	369.5	80.7	170.6	408.9

* 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	4.3 %	4.7 %	3.7 %	4.1 %
15-35	4.4 %	4.4 %	4.5 %	4.4 %
36-60	4.3 %	4.8 %	4.4 %	4.5 %
61-90	-	4.6 %	4.0 %	4.6 %
91-180	4.0 %	4.2 %	4.0 %	4.1 %
>180	3.9 %	3.8 %	3.7 %	3.8 %
Total	4.3 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %

*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	18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre				2 al 6 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	155	4924	4535	19	144	4173	4168	15	152	3805	3895
Intragrupo y off-shore***	0	0	2525	2272	0	0	1557	1434	0	0	1613	842
Otros	155	14	680	1322	144	19	1061	1189	152	15	746	1428
Total	169	169	8129	8129	163	163	6791	6791	167	167	6164	6164

* 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.