

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1847.7 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	410.3	454.8	364.4	344.6	27.9	3.2	62.5
15-35	595.0	394.9	156.5	222.0	143.4	278.0	95.0
36-60	47.4	13.8	10.0	10.0	3.8	37.4	0.0
61-90	1.9	13.3	0.0	0.0	13.3	1.9	0.0
91-180	1.5	40.7	30.0	0.0	10.7	1.5	0.0
>180	10.0	21.7	20.0	10.0	1.7	0.0	0.0
Total	1066.1	939.1	580.9	586.6	200.7	322.0	157.5

* 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	4.5 %	5.3 %	4.4 %	4.9 %
15-35	4.5 %	5.2 %	4.4 %	4.7 %
36-60	-	4.8 %	4.2 %	4.2 %
61-90	-	4.6 %	4.1 %	4.6 %
91-180	-	4.4 %	4.2 %	4.4 %
>180	-	3.8 %	3.8 %	3.8 %
Total	4.5 %	5.1 %	4.4 %	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	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**	15	158	5264	4853	19	150	4227	4280	15	158	3826	3919
Intragrupo y off-shore***	0	0	2841	2609	0	0	1605	1441	0	0	1614	845
Otros	158	15	679	1321	150	19	1083	1193	158	15	755	1431
Total	172	172	8784	8784	168	168	6914	6914	172	172	6195	6195

* 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.