

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 21 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\$2788.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	709.6	636.5	501.0	563.7	18.0	28.4	117.5
15-35	804.8	718.3	314.5	168.0	12.8	245.8	391.0
36-60	152.6	173.6	30.0	0.0	113.6	122.6	30.0
61-90	35.0	45.2	21.4	24.5	18.8	5.5	5.0
91-180	0.7	19.2	10.0	0.0	9.2	0.7	0.0
>180	23.6	33.2	10.0	0.0	3.2	3.6	20.0
Total	1726.3	1626.0	886.9	756.2	175.7	406.6	563.5

* 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	
3-14	4.5 %	4.6 %	4.8 %	4.7 %
15-35	4.4 %	4.2 %	4.3 %	4.3 %
36-60	4.2 %	4.8 %	4.4 %	4.6 %
61-90	4.2 %	4.8 %	4.0 %	4.4 %
91-180	-	5.0 %	3.3 %	4.9 %
>180	3.9 %	4.0 %	3.7 %	3.9 %
Total	4.4 %	4.5 %	4.4 %	4.4 %

*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	161	5592	4910	20	146	5139	5110	15	158	4153	4254
Intragrupo y off-shore***	0	0	2865	2920	0	0	2268	2149	0	0	1699	930
Otros	161	15	691	1319	146	20	1145	1293	158	15	903	1572
Total	176	176	9149	9149	167	167	8552	8552	174	174	6755	6755

* 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.