

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 22 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\$1301.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	395.2	314.6	156.0	230.5	8.6	14.8	150.0
15-35	246.9	318.2	242.4	97.6	35.9	109.2	40.0
36-60	58.0	17.4	0.0	32.0	17.4	26.0	0.0
61-90	16.0	72.1	40.0	0.0	19.1	3.0	13.0
91-180	11.2	21.5	0.0	0.0	21.5	11.2	0.0
>180	18.4	14.9	0.0	10.0	14.9	8.4	0.0
Total	745.6	758.7	438.4	370.1	117.4	172.5	203.0

* 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	
3-14	4.3 %	4.5 %	4.4 %	4.4 %
15-35	4.4 %	4.5 %	4.3 %	4.4 %
36-60	-	4.6 %	4.4 %	4.5 %
61-90	4.1 %	4.2 %	6.7 %	4.3 %
91-180	-	4.3 %	14.1 %	7.7 %
>180	-	4.2 %	10.5 %	6.5 %
Total	4.3 %	4.5 %	4.8 %	4.6 %

*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	5601	4911	19	153	5425	5227	17	158	4260	4426
Intragrupo y off-shore***	0	0	2865	2920	0	0	2360	2377	0	0	1763	932
Otros	161	15	692	1327	153	19	1126	1307	158	17	907	1572
Total	176	176	9158	9158	172	172	8911	8911	175	175	6930	6930

* 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.