Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2017

Fecha de Información: 29 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$1613.4 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	247.0	368.8	89.0	41.8	104.3	29.8	175.5
15-35	709.4	518.5	178.3	219.0	40.0	190.2	300.2
36-60	50.3	10.0	0.0	0.0	10.0	50.3	0.0
61-90	30.9	45.4	10.0	0.0	30.4	25.9	5.0
91-180	38.5	29.2	0.0	20.0	19.2	8.5	10.0
>180	9.2	46.9	40.0	5.0	6.9	4.2	0.0
Total	**1085.2**	**1018.8**	**317.3**	**285.8**	**210.9**	**308.8**	**490.7**

* 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	4.6 %	4.7 %	3.6 %	4.5 %
15-35	4.6 %	4.4 %	4.5 %	4.5 %
36-60	-	4.8 %	4.3 %	4.4 %
61-90	4.1 %	4.5 %	4.1 %	4.3 %
91-180	3.9 %	4.2 %	3.5 %	3.8 %
>180	-	3.7 %	3.4 %	3.7 %
Total	4.6 %	4.5 %	4.3 %	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	25 al 29 de septiembre				2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	152	6036	5448	28	159	4734	5111	8	105	4125	3997
Intragrupo y off-shore***	0	0	2444	2857	0	0	2135	1085	0	0	1589	1098
Otros	152	32	1160	1335	159	28	986	1658	105	8	1041	1660
Total	**184**	**184**	**9640**	**9640**	**187**	**187**	**7854**	**7854**	**113**	**113**	**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.