

Fecha de Publicación: 6 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 04 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\$76.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19.9	15.1	15.0	15.0	0.1	4.9	0.0
15-35	13.9	2.1	0.0	10.0	2.1	3.9	0.0
36-60	7.7	1.8	0.0	0.0	1.8	7.7	0.0
61-90	0.3	3.9	0.0	0.0	3.9	0.3	0.0
91-180	1.4	8.5	0.0	0.0	8.5	1.4	0.0
>180	0.3	1.1	0.0	0.0	1.1	0.3	0.0
Total	43.5	32.5	15.0	25.0	17.5	18.5	0.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	4.9 %	4.5 %	4.7 %
15-35	-	5.5 %	4.6 %	4.7 %
36-60	-	5.2 %	4.0 %	4.2 %
61-90	-	4.9 %	4.3 %	4.9 %
91-180	-	4.8 %	4.4 %	4.8 %
>180	-	4.6 %	4.1 %	4.4 %
Total	-	4.9 %	4.5 %	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

Sector	4 al 8 de septiembre				11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	91	4778	4266	26	139	3357	3688	9	168	3069	3193
Intragruppo y off-shore***	0	0	1990	1683	0	0	1841	1011	0	0	1773	990
Otros	91	18	934	1754	139	26	929	1428	168	9	548	1207
Total	108	108	7702	7702	165	165	6127	6127	176	176	5389	5389

* 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 intragruppo.