

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2017

Fecha de Información: 03 de octubre 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\$2103.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	427.4	326.9	53.0	150.5	84.9	87.9	189.0
15-35	810.4	728.6	207.3	146.8	140.4	282.7	381.0
36-60	101.7	157.3	58.5	0.0	58.8	61.7	40.0
61-90	10.0	33.7	0.0	0.0	33.7	10.0	0.0
91-180	60.9	12.5	0.0	60.0	12.5	0.9	0.0
>180	10.3	43.8	30.0	0.0	3.8	0.3	10.0
Total	1420.7	1302.9	348.8	357.3	334.1	443.5	620.0

* 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	4.6 %	4.7 %	4.6 %	4.6 %
15-35	4.7 %	4.6 %	4.5 %	4.6 %
36-60	3.5 %	5.3 %	4.3 %	4.6 %
61-90	-	4.4 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.4 %	4.0 %	4.1 %
>180	3.8 %	3.7 %	3.5 %	3.7 %
Total	4.6 %	4.7 %	4.5 %	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	2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	163	5048	5258	9	106	4422	4404	18	149	2786	2740
Intragruppo y off-shore***	0	0	2161	1273	0	0	1699	1103	0	0	1181	882
Otros	163	28	985	1663	106	9	1161	1774	149	18	876	1222
Total	191	191	8194	8194	115	115	7281	7281	167	167	4844	4844

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.