

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2017

Fecha de Información: 04 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\$2414.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 668.2 | 341.8 | 153.0 | 486.0 | 36.8 | 30.2 | 152.0 |
| 15-35 | 372.8 | 764.0 | 515.0 | 70.0 | 67.2 | 121.0 | 181.8 |
| 36-60 | 221.6 | 127.3 | 1.6 | 0.0 | 85.7 | 181.6 | 40.0 |
| 61-90 | 83.5 | 77.8 | 0.2 | 25.0 | 22.6 | 3.5 | 55.0 |
| 91-180 | 47.1 | 69.9 | 1.1 | 0.0 | 23.8 | 2.1 | 45.0 |
| >180 | 107.1 | 92.4 | 0.0 | 22.0 | 7.4 | 0.1 | 85.0 |
| Total | 1500.2 | 1473.3 | 670.9 | 603.0 | 243.6 | 338.4 | 558.8 |

* 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 | 4.1 % | 4.9 % | 4.7 % | 4.6 % |
| 15-35 | 3.5 % | 4.8 % | 4.7 % | 4.5 % |
| 36-60 | 4.8 % | 4.7 % | 4.6 % | 4.6 % |
| 61-90 | 3.4 % | 4.5 % | 4.3 % | 3.9 % |
| 91-180 | 3.6 % | 4.0 % | 3.9 % | 3.8 % |
| >180 | 3.6 % | 4.2 % | 3.8 % | 3.7 % |
| Total | 3.7 % | 4.8 % | 4.6 % | 4.5 % |

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

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** | 30 | 159 | 5499 | 5324 | 9 | 108 | 4598 | 4610 | 18 | 148 | 2884 | 2867 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2216 | 1707 | 0 | 0 | 1769 | 1143 | 0 | 0 | 1209 | 894 |
| Otros | 159 | 30 | 978 | 1663 | 108 | 9 | 1171 | 1786 | 148 | 18 | 953 | 1285 |
| Total | 189 | 189 | 8693 | 8693 | 117 | 117 | 7538 | 7538 | 166 | 166 | 5046 | 5046 |

* 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.