

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2017

Fecha de Información: 05 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\$2101.3 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	431.7	215.9	37.8	291.0	100.1	62.7	78.0
15-35	510.3	948.5	628.1	70.3	153.4	273.0	167.0
36-60	144.0	10.5	0.0	0.0	10.5	144.0	0.0
61-90	14.0	32.8	5.8	0.0	17.1	4.0	10.0
91-180	2.5	35.7	0.0	0.0	35.7	2.5	0.0
>180	2.6	7.7	0.0	0.0	7.7	2.6	0.0
Total	1105.0	1251.2	671.7	361.3	324.6	488.7	255.0

* 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	Compras	Ventas	
3-14	4.8 %	4.7 %	5.3 %	5.1 %
15-35	2.6 %	4.6 %	4.6 %	4.3 %
36-60	-	4.8 %	4.4 %	4.4 %
61-90	4.3 %	4.4 %	4.2 %	4.3 %
91-180	-	4.2 %	3.9 %	4.2 %
>180	-	4.1 %	3.5 %	3.9 %
Total	3.4 %	4.6 %	4.8 %	4.5 %

*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	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	C	V						
Sector Financiero**	26	153	5822	5365	9	110	4686	4708	17	149	2912	3027								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2223	1989	0	0	1778	1149	0	0	1309	897								
Otros	153	26	982	1673	110	9	1227	1835	149	17	998	1296								
Total	178	178	9027	9027	119	119	7692	7692	166	166	5219	5219								

* 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 intragrupo.