

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2017

Fecha de Información: 06 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\$1490.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	274.5	106.6	61.5	202.0	11.1	38.5	34.0
15-35	303.3	637.2	472.0	63.5	5.6	80.3	159.5
36-60	166.9	34.5	0.0	0.0	34.5	166.9	0.0
61-90	12.7	10.2	2.7	0.0	7.5	12.7	0.0
91-180	103.4	52.1	0.0	60.0	17.1	8.4	35.0
>180	15.0	2.1	0.0	15.0	2.1	0.0	0.0
Total	875.9	842.7	536.2	340.5	77.9	306.8	228.5

* 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	4.7 %	4.9 %	5.4 %	5.2 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.4 %	4.6 %
36-60	-	4.7 %	4.4 %	4.5 %
61-90	-	4.6 %	4.1 %	4.3 %
91-180	4.1 %	4.5 %	4.0 %	4.1 %
>180	-	4.1 %	3.8 %	3.8 %
Total	4.5 %	4.7 %	4.7 %	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	Vencimientos de Forwards											
	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**	25	151	5822	5365	11	128	4883	4723	17	150	2988	3046
Intragrupa y off-shore***	0	0	2223	1989	0	0	1836	1306	0	0	1312	942
Otros	151	25	982	1674	128	11	1160	1851	150	17	1004	1317
Total	177	177	9027	9027	139	139	7879	7879	167	167	5304	5304

* 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.