

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2017

Fecha de Información: 09 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\$214.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	85.0	82.2	3.0	3.0	9.2	12.0	70.0
15-35	38.8	87.0	55.5	4.0	1.5	4.8	30.0
36-60	3.9	1.1	0.0	0.0	1.1	3.9	0.0
61-90	1.3	0.6	0.0	0.0	0.6	1.3	0.0
91-180	3.3	9.9	0.0	0.0	9.9	3.3	0.0
>180	1.0	0.0	0.0	0.0	0.0	1.0	0.0
Total	133.3	180.9	58.5	7.0	22.4	26.3	100.0

* 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 %	4.8 %	3.8 %	4.6 %
15-35	4.7 %	4.7 %	4.1 %	4.6 %
36-60	-	4.9 %	4.1 %	4.2 %
61-90	-	4.6 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.8 %	3.7 %	4.5 %
>180	-	6.0 %	3.1 %	3.3 %
Total	4.7 %	4.7 %	3.9 %	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

Sector	9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre				23 al 27 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	129	4889	4730	15	148	3051	3104	14	135	4056	3642
Intragrupa y off-shore***	0	0	1836	1309	0	0	1312	942	0	0	1790	1320
Otros	128	13	1168	1854	148	15	1007	1325	135	14	723	1606
Total	142	142	7893	7893	164	164	5370	5370	149	149	6569	6569

* 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.