

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2017

Fecha de Información: 10 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\$2176.5 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	372.2	310.8	161.8	145.5	18.0	95.6	131.1
15-35	682.5	678.7	250.5	135.8	144.4	262.9	283.8
36-60	274.2	140.5	0.0	0.0	130.5	264.2	10.0
61-90	22.1	5.3	0.0	0.0	5.3	22.1	0.0
91-180	50.9	19.9	0.0	30.0	9.9	10.9	10.0
>180	49.9	24.5	0.0	20.0	4.5	9.9	20.0
Total	1451.8	1179.6	412.3	331.3	312.4	665.6	454.9

* 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	4.6 %	4.7 %	4.8 %	4.7 %
15-35	4.6 %	4.7 %	4.4 %	4.6 %
36-60	4.3 %	4.7 %	4.5 %	4.5 %
61-90	-	4.6 %	4.1 %	4.2 %
91-180	4.1 %	4.2 %	4.1 %	4.1 %
>180	3.6 %	3.9 %	3.4 %	3.5 %
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.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	15	130	5084	4846	15	147	3219	3273	13	135	4169	3777
Intragruppo y off-shore***	0	0	1908	1453	0	0	1385	945	0	0	1835	1320
Otros	130	15	1176	1869	147	15	1018	1404	135	13	783	1689
Total	145	145	8167	8167	162	162	5622	5622	148	148	6786	6786

* 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.