

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2017

Fecha de Información: 12 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\$2231.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	262.5	209.3	151.0	211.0	23.3	16.5	35.0
15-35	1016.9	878.5	359.3	210.0	193.3	480.9	326.0
36-60	11.0	57.5	52.0	0.0	5.5	11.0	0.0
61-90	0.4	42.0	25.0	0.0	17.0	0.4	0.0
91-180	21.8	21.1	0.0	10.0	11.1	1.8	10.0
>180	50.0	61.6	30.0	20.0	1.6	0.0	30.0
Total	1362.7	1270.0	617.2	451.0	251.7	510.7	401.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.3 %	5.2 %	3.7 %	4.3 %
15-35	4.4 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %
36-60	-	4.5 %	3.4 %	4.3 %
61-90	-	4.4 %	3.9 %	4.4 %
91-180	4.2 %	4.3 %	4.1 %	4.2 %
>180	3.8 %	3.7 %	3.8 %	3.8 %
Total	4.4 %	4.6 %	4.2 %	4.4 %

*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**	17	139	5475	5070	22	147	3430	3451	14	136	4410	4154
Intragruppo y off-shore***	0	0	2050	1740	0	0	1425	968	0	0	1981	1348
Otros	139	17	1173	1888	147	22	1015	1451	136	14	896	1785
Total	156	156	8698	8698	169	169	5871	5871	150	150	7288	7288

* 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 intragruppo.