

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2017

Fecha de Información: 13 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\$1810.9 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 | 381.0 | 430.1 | 83.0 | 36.5 | 36.1 | 33.5 | 311.0 |
| 15-35 | 687.3 | 572.8 | 117.5 | 178.3 | 182.3 | 236.1 | 273.0 |
| 36-60 | 21.5 | 23.1 | 0.0 | 15.0 | 23.1 | 6.5 | 0.0 |
| 61-90 | 2.4 | 23.7 | 1.5 | 0.0 | 22.2 | 2.4 | 0.0 |
| 91-180 | 53.7 | 41.7 | 0.0 | 40.0 | 31.7 | 3.7 | 10.0 |
| >180 | 81.2 | 126.3 | 50.0 | 40.0 | 36.3 | 1.2 | 40.0 |
| Total | 1227.1 | 1217.7 | 252.0 | 309.8 | 331.7 | 283.4 | 634.0 |

* 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 | 5.7 % | 4.9 % | 4.1 % | 5.3 % |
| 15-35 | 4.3 % | 4.6 % | 4.4 % | 4.4 % |
| 36-60 | - | 4.8 % | 4.5 % | 4.7 % |
| 61-90 | - | 4.5 % | 8.0 % | 4.8 % |
| 91-180 | 4.1 % | 4.5 % | 4.1 % | 4.3 % |
| >180 | 3.7 % | 3.6 % | 3.5 % | 3.6 % |
| Total | 4.9 % | 4.5 % | 4.3 % | 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

| 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** | 17 | 138 | 5475 | 5072 | 22 | 161 | 3624 | 3646 | 14 | 136 | 4597 | 4374 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2050 | 1740 | 0 | 0 | 1483 | 1001 | 0 | 0 | 2006 | 1352 |
| Otros | 138 | 17 | 1175 | 1888 | 161 | 22 | 1019 | 1479 | 136 | 14 | 913 | 1791 |
| Total | 155 | 155 | 8700 | 8700 | 183 | 183 | 6126 | 6126 | 150 | 150 | 7516 | 7516 |

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.