

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2017

Fecha de Información: 17 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\$1624.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	368.8	242.4	127.3	244.1	28.0	37.7	87.0
15-35	543.6	586.1	304.7	89.4	131.4	304.2	150.0
36-60	1.9	37.6	0.0	0.0	37.6	1.9	0.0
61-90	2.2	2.9	0.0	0.0	2.9	2.2	0.0
91-180	15.4	8.3	0.0	0.0	8.3	15.4	0.0
>180	47.2	17.0	0.0	33.9	4.7	1.0	12.3
Total	979.1	894.2	432.0	367.4	212.8	362.4	249.3

* 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 %	4.7 %	4.8 %	4.8 %
15-35	4.3 %	4.4 %	4.3 %	4.3 %
36-60	-	4.6 %	4.0 %	4.5 %
61-90	-	4.9 %	4.0 %	4.5 %
91-180	-	4.3 %	4.0 %	4.1 %
>180	3.5 %	4.1 %	3.8 %	3.7 %
Total	4.4 %	4.5 %	4.4 %	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	16 al 20 de octubre				23 al 27 de octubre				30 de oct. al 3 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	162	3944	3792	15	137	4634	4450	5	93	3921	3560
Intragrupa y off-shore***	0	0	1568	1244	0	0	2048	1353	0	0	1310	1068
Otros	162	22	1013	1489	137	15	937	1816	93	5	1028	1631
Total	183	183	6525	6525	151	151	7620	7620	98	98	6259	6259

* 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.