

Fecha de Publicación: 20 de octubre de 2017

Fecha de Información: 18 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\$2677.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.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	454.2	303.4	188.0	341.0	26.4	24.2	89.0
15-35	862.5	1159.5	729.1	132.0	134.8	434.9	295.7
36-60	0.6	38.9	0.0	0.0	38.9	0.6	0.0
61-90	63.1	11.9	0.0	60.0	11.9	3.1	0.0
91-180	61.9	28.7	0.0	40.0	23.7	16.9	5.0
>180	57.5	25.4	20.0	16.5	5.4	41.0	0.0
Total	1499.8	1567.8	937.1	589.5	241.0	520.6	389.7

* 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	4.2 %	4.4 %	4.6 %	4.5 %
15-35	4.1 %	4.2 %	3.8 %	4.1 %
36-60	4.5 %	4.4 %	3.6 %	4.4 %
61-90	-	4.6 %	4.1 %	4.1 %
91-180	3.9 %	4.3 %	3.9 %	4.0 %
>180	-	3.6 %	3.5 %	3.5 %
Total	4.1 %	4.2 %	4.0 %	4.1 %

* 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	165	4245	3881	15	136	4755	4643	5	94	3964	3593
Intragrupa y off-shore***	0	0	1618	1507	0	0	2186	1416	0	0	1310	1083
Otros	165	22	1013	1488	136	15	957	1839	94	5	1036	1634
Total	187	187	6876	6876	151	151	7898	7898	99	99	6310	6310

* 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.