

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2017

Fecha de Información: 24 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\$1916.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.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	318.5	284.9	151.0	178.3	24.9	31.3	109.0
15-35	591.7	645.0	382.2	245.8	224.9	307.9	38.0
36-60	68.7	52.7	3.0	20.0	13.7	12.7	36.0
61-90	19.5	0.5	0.0	0.0	0.5	19.5	0.0
91-180	37.6	14.9	0.0	25.0	14.9	12.6	0.0
>180	45.1	30.6	20.0	8.0	0.6	27.1	10.0
Total	1081.1	1028.5	556.2	477.0	279.4	411.1	193.0

* 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	3.9 %	4.1 %	4.6 %	4.3 %
15-35	5.1 %	4.3 %	3.9 %	4.2 %
36-60	4.0 %	4.3 %	3.9 %	4.1 %
61-90	-	7.4 %	3.9 %	4.0 %
91-180	-	4.2 %	3.6 %	3.8 %
>180	4.5 %	2.8 %	3.3 %	3.3 %
Total	4.2 %	4.2 %	4.1 %	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

Sectores	23 al 27 de octubre				30 de oct. al 3 de noviembre				6 al 10 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	145	5428	5194	8	94	4306	3849	16	102	3339	3811
Intragruppo y off-shore***	0	0	2517	1848	0	0	1373	1121	0	0	1668	599
Otros	145	28	963	1865	94	8	1096	1806	102	16	885	1484
Total	173	173	8908	8908	102	102	6776	6776	118	118	5893	5893

* 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 intragruppo.