

Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2017

Fecha de Información: 25 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\$1865.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	269.2	296.4	68.0	26.0	56.4	71.2	172.0
15-35	719.9	491.7	230.2	226.5	136.0	367.9	125.5
36-60	163.0	115.7	0.0	44.7	15.7	18.3	100.0
61-90	10.9	4.1	0.0	0.0	4.1	10.9	0.0
91-180	97.6	76.2	49.7	25.0	6.5	52.6	20.0
>180	26.0	12.1	10.0	20.0	2.1	6.0	0.0
Total	1286.6	996.2	357.9	342.2	220.8	526.9	417.5

* 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	3.9 %	4.0 %	3.4 %	3.8 %
15-35	4.8 %	4.1 %	3.9 %	4.1 %
36-60	4.5 %	4.1 %	3.8 %	4.3 %
61-90	-	4.1 %	3.7 %	3.8 %
91-180	4.4 %	3.9 %	3.6 %	3.8 %
>180	-	3.4 %	3.3 %	3.4 %
Total	4.3 %	4.0 %	3.8 %	4.0 %

*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	5482	5268	11	94	4421	3971	24	102	3470	3965
Intragruppo y off-shore***	0	0	2566	1872	0	0	1392	1121	0	0	1698	601
Otros	145	28	968	1875	94	11	1098	1818	102	24	940	1541
Total	174	174	9016	9016	105	105	6911	6911	127	127	6108	6108

* 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.