

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2017

Fecha de Información: 26 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 4.0%.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	376.5	223.4	56.0	203.5	64.0	69.7	103.3
15-35	452.3	779.9	498.4	55.0	173.2	289.0	108.3
36-60	10.7	39.8	0.0	0.0	39.8	10.7	0.0
61-90	15.3	44.5	35.0	0.0	9.5	15.3	0.0
91-180	31.3	20.3	0.0	0.0	20.3	31.3	0.0
>180	17.2	11.5	10.0	0.0	1.5	17.2	0.0
Total	903.2	1119.3	599.4	258.5	308.3	433.1	211.6

* 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	3.8 %	4.7 %	4.6 %	4.4 %
15-35	4.8 %	4.0 %	3.6 %	3.9 %
36-60	-	4.0 %	3.4 %	3.9 %
61-90	-	3.7 %	3.6 %	3.6 %
91-180	-	3.8 %	3.4 %	3.5 %
>180	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
Total	4.3 %	4.1 %	3.9 %	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

Sector	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	140	5676	5331	23	92	4479	4041	29	103	3579	4065
Intragruppo y off-shore***	0	0	2574	2022	0	0	1420	1140	0	0	1719	636
Otros	140	28	981	1878	92	23	1108	1827	103	29	989	1585
Total	168	168	9231	9231	116	116	7008	7008	133	133	6286	6286

* 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 intragruppo.