

Fecha de Publicación: 1 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 30 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\$2237.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	366.6	246.9	124.8	185.0	45.9	105.4	76.2
15-35	763.3	695.0	375.5	317.3	166.5	293.0	153.0
36-60	23.1	35.2	0.0	0.0	23.0	10.9	12.2
61-90	13.0	3.8	0.0	0.0	3.8	13.0	0.0
91-180	147.5	106.9	0.0	14.2	51.9	78.3	55.0
>180	91.3	79.8	40.0	38.6	0.8	13.8	39.0
Total	1404.8	1167.6	540.3	555.0	291.9	514.4	335.4

* 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	2.8 %	4.1 %	1.2 %	2.4 %
15-35	2.8 %	3.8 %	3.6 %	3.6 %
36-60	3.5 %	6.8 %	3.2 %	5.1 %
61-90	-	3.7 %	3.4 %	3.5 %
91-180	3.4 %	3.8 %	3.4 %	3.5 %
>180	3.2 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
Total	2.9 %	4.0 %	3.0 %	3.3 %

* 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	30 de oct. al 3 de noviembre				6 al 10 de noviembre				13 al 17 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	96	4774	4245	37	102	3855	4267	100	114	3724	3839
Intragruppo y off-shore***	0	0	1531	1289	0	0	1771	713	0	0	1674	803
Otros	96	39	1120	1891	102	37	1035	1682	114	100	1125	1881
Total	134	134	7426	7426	139	139	6662	6662	214	214	6523	6523

* 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.