

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2017

Fecha de Información: 02 de octubre de 2017¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1296.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	216.0	264.4	83.0	46.0	70.4	59.0	111.0
15-35	388.3	322.9	126.5	76.3	93.3	209.1	103.0
36-60	149.9	74.2	0.0	0.0	74.2	149.9	0.0
61-90	4.7	8.0	0.0	0.0	8.0	4.7	0.0
91-180	13.3	10.9	0.0	10.0	10.9	3.3	0.0
>180	55.8	32.1	0.0	20.0	2.1	5.8	30.0
Total	828.0	712.4	209.5	152.3	258.9	431.8	244.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	5.0 %	4.7 %	5.0 %	4.9 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	4.6 %	3.6 %	3.9 %
61-90	-	4.6 %	4.0 %	4.4 %
91-180	-	4.4 %	3.9 %	4.1 %
>180	3.8 %	4.1 %	3.7 %	3.8 %
Total	4.7 %	4.7 %	4.3 %	4.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	157	4819	5173	8	105	4255	4195	18	147	2697	2678
Intragrupo y off-shore***	0	0	2153	1126	0	0	1654	1103	0	0	1181	865
Otros	157	28	990	1662	105	8	1104	1715	147	18	849	1185
Total	186	186	7962	7962	113	113	7013	7013	165	165	4728	4728

* 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.