

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2017

Fecha de Información: 27 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\$1241.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	230.1	165.6	39.0	41.0	18.3	80.8	108.3
15-35	515.1	497.2	211.5	179.8	101.4	151.1	184.3
36-60	12.1	18.3	5.0	0.8	8.3	6.3	5.0
61-90	4.7	2.3	0.0	0.0	2.3	4.7	0.0
91-180	73.4	6.9	0.0	1.8	6.9	71.6	0.0
>180	5.4	8.4	0.0	0.0	8.4	5.4	0.0
Total	840.8	698.7	255.5	223.3	145.6	319.9	297.6

* 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 intragrupo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	2.7 %	3.7 %	3.5 %
15-35	3.9 %	4.1 %	3.8 %	3.9 %
36-60	3.9 %	4.0 %	3.3 %	3.8 %
61-90	-	4.8 %	3.4 %	3.9 %
91-180	-	3.9 %	3.5 %	3.5 %
>180	-	4.4 %	3.2 %	3.9 %
Total	3.8 %	3.9 %	3.7 %	3.8 %

*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	139	5676	5339	35	98	4587	4072	35	103	3683	4188
Intragrupo y off-shore***	0	0	2574	2022	0	0	1421	1181	0	0	1757	636
Otros	139	28	989	1878	98	35	1113	1867	103	35	992	1608
Total	167	167	9239	9239	133	133	7121	7121	138	138	6432	6432

* 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.