Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2017

Fecha de Información: 23 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$1377.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.[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	267.2	169.3	47.0	112.8	30.3	62.4	92.0
15-35	473.5	313.7	141.5	82.0	40.3	259.5	132.0
36-60	133.8	96.9	17.0	0.0	79.9	133.8	0.0
61-90	4.8	0.7	0.0	0.0	0.7	4.8	0.0
91-180	52.4	32.6	0.0	10.0	22.6	32.4	10.0
>180	30.4	46.4	20.0	19.0	16.4	1.4	10.0
Total	**962.1**	**659.6**	**225.5**	**223.8**	**190.1**	**494.3**	**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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.0 %	4.5 %	3.8 %	4.0 %
15-35	4.2 %	4.3 %	4.0 %	4.1 %
36-60	-	4.2 %	4.0 %	4.1 %
61-90	-	4.1 %	3.9 %	3.9 %
91-180	5.7 %	4.2 %	3.8 %	4.2 %
>180	3.6 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
Total	4.2 %	4.3 %	3.9 %	4.1 %

*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	146	5233	5020	8	94	4185	3726	14	97	3300	3774
Intragrupo y off-shore***	0	0	2378	1688	0	0	1341	1103	0	0	1638	576
Otros	146	28	954	1858	94	8	1087	1785	97	14	879	1467
Total	**175**	**175**	**8565**	**8565**	**101**	**101**	**6614**	**6614**	**111**	**111**	**5817**	**5817**

* 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.