

Fecha de Publicación: 3 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$2839.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	624.8	315.7	64.3	368.8	102.4	107.0	149.0
15-35	913.3	888.2	497.5	300.8	144.1	366.0	246.6
36-60	114.7	66.2	3.0	0.0	53.2	104.7	10.0
61-90	15.1	21.3	0.0	0.0	21.3	15.1	0.0
91-180	38.5	62.7	50.0	10.0	12.7	28.5	0.0
>180	157.8	146.2	25.4	0.0	0.8	37.8	120.0
Total	1864.2	1500.4	640.2	679.6	334.6	659.1	525.6

* 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	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	2.8 %	3.5 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.5 %	3.5 %
36-60	3.5 %	3.9 %	3.6 %	3.7 %
61-90	-	3.4 %	2.9 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	3.0 %	3.2 %
>180	3.1 %	3.4 %	2.9 %	3.1 %
Total	3.4 %	3.4 %	3.4 %	3.4 %

*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**	38	96	5281	4452	39	105	4134	4468	102	115	3836	3924
Intragrupa y off-shore***	0	0	1650	1668	0	0	1784	799	0	0	1691	843
Otros	96	38	1092	1904	105	39	1085	1736	115	102	1187	1947
Total	135	135	8023	8023	143	143	7003	7003	217	217	6714	6714

* 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.