

Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 03 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\$2545.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	461.8	259.5	161.5	350.3	16.5	30.0	81.5
15-35	728.3	721.1	441.4	324.3	161.9	286.3	117.8
36-60	50.9	7.4	0.0	0.0	7.4	50.9	0.0
61-90	37.3	339.3	310.6	0.0	17.8	26.3	11.0
91-180	30.5	35.4	30.0	0.0	5.4	30.5	0.0
>180	46.2	38.0	25.0	10.1	13.0	36.1	0.0
Total	1355.0	1400.6	968.5	684.7	221.9	460.1	210.3

* 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	3.6 %	3.3 %	2.7 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.8 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.2 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	2.9 %	3.1 %
>180	-	3.3 %	2.8 %	3.0 %
Total	3.5 %	3.5 %	3.3 %	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**	37	103	5340	4513	45	110	4635	4753	106	110	4031	4089
Intragruppo y off-shore***	0	0	1652	1681	0	0	1994	1189	0	0	1749	931
Otros	103	37	1101	1900	110	45	1081	1768	110	106	1220	1979
Total	140	140	8093	8093	155	155	7709	7709	216	216	6999	6999

* 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 intragruppo.