

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 07 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\$2219.0 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	378.3	358.9	150.0	201.0	100.1	68.5	108.8
15-35	661.9	716.5	462.2	189.8	131.7	349.5	122.6
36-60	22.6	48.0	24.0	0.0	24.0	22.6	0.0
61-90	112.0	25.9	0.0	0.0	25.9	112.0	0.0
91-180	43.0	65.7	10.0	10.0	25.7	3.0	30.0
>180	33.3	34.3	0.0	0.0	14.3	13.3	20.0
Total	1251.0	1249.3	646.2	400.7	321.7	568.9	281.4

* 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	0.7 %	4.0 %	3.9 %	3.3 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	3.7 %	3.2 %	3.5 %
61-90	-	3.4 %	3.2 %	3.2 %
91-180	3.2 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
>180	3.1 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
Total	2.4 %	3.7 %	3.5 %	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

Sector	6 al 10 de noviembre				13 al 17 de noviembre				20 al 24 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	100	4878	4894	112	113	4119	4186	31	105	2909	3310
Intragruppo y off-shore***	0	0	2062	1379	0	0	1764	941	0	0	1544	881
Otros	100	47	1101	1769	113	112	1288	2043	105	31	901	1161
Total	146	146	8041	8041	225	225	7171	7171	136	136	5353	5353

* 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.