

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 08 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\$2667.4 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	721.1	455.1	128.0	392.5	117.1	118.6	210.0
15-35	786.3	743.3	377.4	194.5	49.4	275.3	316.5
36-60	14.4	117.4	100.0	0.0	7.4	4.4	10.0
61-90	122.9	65.9	0.0	0.0	65.9	122.9	0.0
91-180	30.7	54.5	10.0	0.0	19.5	5.7	25.0
>180	100.0	112.3	2.5	0.0	14.8	5.0	95.0
Total	1775.4	1548.6	617.9	587.0	274.1	531.8	656.5

* 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	3.7 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %
15-35	3.4 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %
36-60	3.2 %	3.4 %	3.1 %	3.4 %
61-90	-	3.3 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.1 %	3.3 %	2.9 %	3.2 %
>180	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.0 %
Total	3.4 %	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

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**	46	102	5291	5002	110	114	4305	4282	31	105	3049	3516
Intragrupa y off-shore***	0	0	2105	1703	0	0	1769	1004	0	0	1624	887
Otros	102	46	1077	1768	114	110	1344	2131	105	31	941	1211
Total	148	148	8473	8473	224	224	7418	7418	136	136	5614	5614

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.