

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 09 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\$1870.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	324.7	236.3	91.0	172.0	47.9	55.3	97.4
15-35	568.5	598.5	292.0	159.1	104.6	207.4	201.9
36-60	0.6	31.4	25.0	0.0	6.3	0.5	0.0
61-90	201.0	145.6	0.0	0.0	130.6	186.0	15.0
91-180	7.0	23.9	0.0	0.0	23.9	7.0	0.0
>180	5.4	47.5	0.0	0.0	42.5	0.4	5.0
Total	1107.1	1083.1	408.0	331.1	355.7	456.6	319.4

* 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	3.3 %	3.2 %	3.4 %	3.3 %
15-35	2.2 %	3.5 %	3.3 %	3.1 %
36-60	3.6 %	3.4 %	2.9 %	3.4 %
61-90	3.1 %	3.4 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	2.8 %	3.2 %
>180	2.7 %	3.4 %	2.5 %	3.3 %
Total	2.6 %	3.4 %	3.3 %	3.2 %

*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	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**	45	98	5399	5063	112	116	4440	4385	32	106	3131	3632
Intragruppo y off-shore***	0	0	2132	1787	0	0	1828	1092	0	0	1672	887
Otros	98	45	1083	1764	116	112	1347	2139	106	32	980	1263
Total	143	143	8614	8614	228	228	7615	7615	139	139	5783	5783

* 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.