

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1318.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	179.4	171.0	48.0	69.5	34.5	21.4	88.5
15-35	275.1	379.9	219.5	153.3	58.9	20.3	101.5
36-60	0.1	8.7	0.0	0.0	8.7	0.1	0.0
61-90	228.4	191.2	30.0	0.0	161.2	228.4	0.0
91-180	26.7	28.9	0.0	20.0	28.9	6.7	0.0
>180	10.7	8.7	0.0	0.0	8.7	10.7	0.0
Total	720.4	788.4	297.5	242.8	300.9	287.6	190.0

* 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	3.1 %	3.6 %	-	-
15-35	3.5 %	3.5 %	3.5 %	3.5 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	4.0 %
61-90	-	3.2 %	3.1 %	3.1 %
91-180	-	4.0 %	3.0 %	3.5 %
>180	-	3.2 %	2.8 %	3.0 %
Total	3.3 %	3.5 %	-	-

*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	97	5407	5064	112	128	4530	4465	32	116	3211	3702
Intragrupa y off-shore***	0	0	2132	1795	0	0	1873	1153	0	0	1675	887
Otros	97	46	1083	1764	128	112	1358	2142	116	32	983	1280
Total	143	143	8623	8623	241	241	7761	7761	148	148	5869	5869

* 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.