

Fecha de Publicación: 17 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 15 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%.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	746.2	397.4	132.0	482.0	10.3	9.1	255.1
15-35	761.8	1082.9	628.5	138.5	239.7	408.6	214.7
36-60	6.0	8.2	5.0	0.0	3.2	6.0	0.0
61-90	78.4	108.5	0.0	0.0	108.5	78.4	0.0
91-180	11.6	32.5	0.0	0.0	22.5	1.6	10.0
>180	61.4	21.1	10.0	51.0	6.1	5.4	5.0
Total	1665.5	1650.6	775.5	671.5	390.3	509.2	484.8

* 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	3.5 %	3.8 %	3.4 %	3.5 %
15-35	3.5 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.5 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	3.1 %	3.0 %	3.1 %
91-180	3.0 %	3.1 %	2.8 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.8 %	2.8 %
Total	3.5 %	3.4 %	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	13 al 17 de noviembre				20 al 24 de noviembre				27 de nov. al 1 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	114	127	5133	4689	33	119	3472	3963	16	96	4641	4903
Intragruppo y off-shore***	0	0	2087	1686	0	0	1766	953	0	0	1827	1267
Otros	127	114	1304	2148	119	33	990	1311	96	16	1685	1983
Total	241	241	8523	8523	152	152	6228	6228	112	112	8153	8153

* 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.