

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 17 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\$1549.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	237.1	328.2	167.0	88.5	107.7	95.1	53.5
15-35	452.4	391.8	158.3	228.5	49.6	39.9	184.0
36-60	0.0	7.5	0.0	0.0	7.5	0.0	0.0
61-90	155.6	101.8	0.0	0.5	101.8	155.1	0.0
91-180	41.3	90.7	0.0	1.0	50.7	0.3	40.0
>180	11.8	9.0	0.0	10.0	9.0	1.8	0.0
Total	898.2	928.9	325.3	328.5	326.2	292.2	277.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	4.0 %	3.6 %	3.8 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	4.6 %	2.8 %	4.6 %
61-90	-	3.5 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.2 %	3.3 %	2.9 %	3.2 %
>180	-	3.2 %	2.8 %	3.0 %
Total	3.6 %	3.8 %	3.4 %	3.6 %

*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	126	5211	4720	34	131	3563	4072	17	99	4977	5288
Intragruppo y off-shore***	0	0	2098	1743	0	0	1878	993	0	0	1946	1360
Otros	126	114	1314	2159	131	34	957	1333	99	17	1798	2072
Total	241	241	8622	8622	165	165	6398	6398	115	115	8721	8721

* 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 intragruppo.