

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 20 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\$1860.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	383.7	360.9	168.5	189.0	63.4	65.7	129.0
15-35	382.1	436.6	269.3	92.5	8.3	130.6	159.0
36-60	4.4	13.3	0.0	0.0	13.3	4.4	0.0
61-90	276.1	235.8	0.0	0.0	235.8	276.1	0.0
91-180	2.3	14.2	0.0	0.0	14.2	2.3	0.0
>180	16.4	27.8	0.0	10.0	22.8	1.4	5.0
Total	1064.9	1088.6	437.8	291.5	357.8	480.4	293.0

* 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	4.6 %	3.6 %	4.9 %	4.4 %
15-35	4.2 %	3.6 %	3.4 %	3.7 %
36-60	-	4.5 %	3.1 %	4.1 %
61-90	-	3.3 %	3.2 %	3.3 %
91-180	-	3.4 %	2.9 %	3.3 %
>180	2.8 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
Total	4.3 %	3.5 %	3.8 %	3.8 %

*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	20 al 24 de noviembre				27 de nov. al 1 de diciembre				4 al 8 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	133	3864	4281	17	106	5059	5376	5	99	3396	3702
Intragrupos y off-shore***	0	0	1991	1182	0	0	1958	1360	0	0	1937	999
Otros	133	35	944	1336	106	17	1854	2135	99	5	791	1423
Total	168	168	6799	6799	122	122	8871	8871	105	105	6124	6124

* 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 intragrupo.