

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 21 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\$1262.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	218.6	169.9	130.5	180.1	25.9	25.0	13.5
15-35	341.1	357.3	167.8	143.5	38.9	47.1	150.5
36-60	42.9	40.4	0.0	0.0	40.4	42.9	0.0
61-90	112.7	49.9	12.9	0.0	17.0	92.7	20.0
91-180	23.0	50.5	0.0	0.0	50.5	23.0	0.0
>180	26.7	28.0	0.0	5.0	14.0	7.7	14.0
Total	764.9	696.0	311.2	328.6	186.7	238.3	198.0

* 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	3.7 %	4.5 %	2.9 %	3.6 %
15-35	4.1 %	3.7 %	3.6 %	3.8 %
36-60	-	3.4 %	3.3 %	3.4 %
61-90	3.3 %	3.6 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	3.0 %	3.2 %
>180	2.7 %	3.0 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.9 %	3.9 %	3.2 %	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	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	126	4053	4293	19	116	5083	5510	6	100	3399	3735
Intragrupa y off-shore***	0	0	1995	1357	0	0	2065	1365	0	0	1957	999
Otros	126	35	942	1339	116	19	1878	2150	100	6	803	1426
Total	161	161	6990	6990	135	135	9026	9026	106	106	6159	6159

* 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 intragrupo.