

Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 22 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\$2352.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	319.0	392.0	198.0	214.0	130.0	41.0	64.0
15-35	643.7	662.9	300.6	308.8	123.3	95.9	239.0
36-60	23.6	25.8	10.0	20.0	15.8	3.6	0.0
61-90	270.5	129.0	0.1	0.0	129.0	270.5	0.0
91-180	14.1	93.6	14.1	10.0	79.5	4.1	0.0
>180	55.6	26.0	8.4	45.0	17.6	10.6	0.0
Total	1326.5	1329.3	531.2	597.8	495.1	425.7	303.0

* 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	-3.8 %	4.6 %	3.3 %	2.8 %
15-35	3.6 %	4.2 %	3.5 %	3.8 %
36-60	-	3.8 %	3.4 %	3.6 %
61-90	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.4 %	3.0 %	3.3 %
>180	-	3.2 %	2.8 %	2.9 %
Total	2.1 %	4.0 %	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

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	126	4168	4184	20	119	5211	5415	6	101	3476	3773
Intragruppo y off-shore***	0	0	2001	1473	0	0	2257	1445	0	0	1957	1017
Otros	126	35	826	1338	119	20	1559	2167	101	6	810	1453
Total	161	161	6995	6995	138	138	9027	9027	107	107	6243	6243

* 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.