

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 23 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\$95.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.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	21.1	29.9	14.0	14.0	15.9	7.1	0.0
15-35	2.2	25.9	13.6	2.0	12.4	0.2	0.0
36-60	0.6	2.2	0.0	0.0	2.2	0.6	0.0
61-90	0.0	4.6	0.0	0.0	4.6	0.0	0.0
91-180	0.0	7.6	0.0	0.0	7.6	0.0	0.0
>180	0.1	1.6	0.0	0.0	1.6	0.1	0.0
Total	23.9	71.9	27.6	16.0	44.4	7.9	0.0

* 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	-	3.9 %	3.5 %	3.7 %
15-35	-	4.2 %	3.5 %	4.2 %
36-60	-	4.0 %	3.2 %	3.9 %
61-90	-	3.9 %	2.8 %	3.9 %
91-180	-	3.4 %	3.0 %	3.4 %
>180	-	3.4 %	2.8 %	3.3 %
Total	-	3.9 %	3.5 %	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	129	4169	4181	19	119	5232	5438	6	101	3476	3778
Intragruppo y off-shore***	0	0	2001	1473	0	0	2271	1459	0	0	1957	1017
Otros	129	35	823	1339	119	19	1568	2173	101	6	814	1453
Total	164	164	6993	6993	139	139	9071	9071	107	107	6247	6247

* 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.