

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 24 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\$918.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	135.3	184.2	95.0	43.5	16.2	18.8	73.0
15-35	283.3	280.9	125.0	100.0	22.4	49.8	133.5
36-60	3.6	6.5	0.0	0.0	6.5	3.6	0.0
61-90	85.1	42.6	20.0	0.0	7.6	70.1	15.0
91-180	0.7	26.5	0.0	0.0	26.5	0.7	0.0
>180	80.0	11.6	0.0	80.0	11.6	0.0	0.0
Total	588.0	552.4	240.0	223.5	90.9	143.0	221.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.6 %	4.0 %	4.2 %	3.9 %
15-35	3.6 %	3.9 %	3.4 %	3.6 %
36-60	-	4.1 %	3.2 %	3.8 %
61-90	3.3 %	3.5 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.4 %	2.7 %	3.4 %
>180	-	3.1 %	2.6 %	2.6 %
Total	3.6 %	3.8 %	3.3 %	3.5 %

*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	4173	4181	21	122	5262	5533	6	104	3578	3863
Intragrupa y off-shore***	0	0	2001	1473	0	0	2351	1473	0	0	1972	1047
Otros	129	35	824	1343	122	21	1574	2181	104	6	821	1461
Total	164	164	6997	6997	143	143	9186	9186	110	110	6371	6371

* 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.