

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 27 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\$1898.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	438.2	152.7	98.5	319.2	4.0	68.9	50.2
15-35	398.4	588.0	387.9	195.0	16.7	19.9	183.5
36-60	112.1	42.2	10.0	20.0	32.2	92.1	0.0
61-90	83.0	78.6	0.0	0.0	77.2	81.6	1.4
91-180	23.2	75.9	50.0	20.0	25.0	2.2	1.0
>180	130.0	67.3	0.0	75.0	12.3	0.0	55.0
Total	1185.0	1004.7	546.3	629.1	167.3	264.8	291.1

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.2 %	3.5 %	3.5 %	3.7 %
15-35	4.2 %	3.4 %	3.3 %	3.6 %
36-60	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
91-180	2.9 %	3.3 %	2.2 %	2.8 %
>180	2.7 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
Total	4.1 %	3.4 %	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	27 de nov. al 1 de diciembre				4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	120	5626	5658	6	104	3646	3891	7	128	3182	3280
Intragruppo y off-shore***	0	0	2442	1789	0	0	1979	1049	0	0	1457	754
Otros	120	25	1578	2199	104	6	821	1507	128	7	899	1503
Total	145	145	9646	9646	110	110	6446	6446	135	135	5538	5538

* 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 intragruppo.