

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 16 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\$1318.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	256.7	224.7	61.0	102.0	24.5	15.5	139.2
15-35	730.9	566.3	191.0	168.0	254.1	441.7	121.2
36-60	0.1	3.3	0.0	0.0	3.3	0.1	0.0
61-90	177.0	169.0	30.0	10.0	109.0	137.0	30.0
91-180	21.0	26.5	0.0	20.0	25.5	0.0	1.0
>180	40.0	36.3	10.0	20.0	16.3	10.0	10.0
Total	1225.7	1026.0	292.0	320.0	432.6	604.3	301.4

* 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	3.5 %	3.2 %	2.7 %	3.2 %
15-35	3.5 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	4.2 %	2.7 %	4.2 %
61-90	3.3 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %
91-180	2.9 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
>180	2.8 %	2.7 %	2.8 %	2.8 %
Total	3.5 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %

* 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	13 al 17 de noviembre				20 al 24 de noviembre				27 de nov. al 1 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	114	127	5200	4703	33	119	3481	3956	16	97	4821	5080
Intragruppo y off-shore***	0	0	2098	1743	0	0	1785	953	0	0	1858	1312
Otros	127	114	1297	2149	119	33	959	1315	97	16	1706	1994
Total	242	242	8595	8595	153	153	6224	6224	113	113	8385	8385

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.