

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 29 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\$2117.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	386.4	178.7	59.0	247.0	10.4	30.1	109.3
15-35	491.8	741.0	455.0	186.0	37.3	57.1	248.8
36-60	160.4	139.9	30.0	0.0	79.9	130.4	30.0
61-90	199.1	114.7	0.0	0.0	109.7	194.1	5.0
91-180	6.5	17.3	0.0	0.0	11.3	0.5	6.0
>180	32.4	70.4	30.0	10.0	18.4	0.4	22.0
Total	1276.6	1262.0	574.0	443.0	267.0	412.6	421.0

* 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	9.0 %		3.7 %	3.7 %	5.0 %
15-35	3.6 %		3.6 %	3.6 %	3.6 %
36-60	3.1 %		3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.2 %		3.3 %	3.0 %	3.1 %
91-180	3.1 %		3.2 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.7 %		2.7 %	2.6 %	2.7 %
Total	4.9 %		3.5 %	3.4 %	3.7 %

*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**	23	221	5987	5831	19	126	3758	4027	20	129	3345	3425
Intragrupo y off-shore***	0	0	2605	2045	0	0	2055	1087	0	0	1497	807
Otros	221	23	1496	2212	126	19	813	1512	129	20	915	1524
Total	243	243	10088	10088	145	145	6626	6626	149	149	5756	5756

* 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.