

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 30 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\$2769.3 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	151.5	230.1	150.0	22.0	13.7	63.1	66.4
15-35	618.0	765.7	463.2	323.3	40.5	32.7	262.0
36-60	114.7	66.7	1.3	0.0	55.4	104.7	10.0
61-90	544.2	531.3	220.0	0.0	287.1	520.0	24.2
91-180	56.2	9.5	0.0	44.6	9.5	11.6	0.0
>180	25.1	23.9	5.0	20.0	13.9	0.1	5.0
Total	1509.6	1627.2	839.5	409.9	420.1	732.2	367.6

* 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	9.6 %	3.5 %	3.4 %	5.0 %
15-35	3.9 %	3.8 %	3.6 %	3.7 %
36-60	3.7 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
61-90	3.2 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.0 %	2.7 %	2.8 %
>180	2.6 %	3.2 %	2.6 %	2.8 %
Total	4.9 %	3.4 %	3.2 %	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

Sector	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	219	6043	5878	20	126	3846	4107	20	130	3350	3528
Intragrupa y off-shore***	0	0	2615	2066	0	0	2094	1087	0	0	1598	808
Otros	219	23	1500	2214	126	20	821	1566	130	20	917	1529
Total	242	242	10158	10158	146	146	6761	6761	150	150	5865	5865

* 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.