

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 11 de diciembre 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\$1247.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.9%.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	287.9	188.3	106.9	150.9	33.4	89.0	48.0
15-35	145.8	347.8	196.8	34.0	58.5	19.3	92.5
36-60	67.6	31.8	1.0	0.0	30.8	67.6	0.0
61-90	189.0	79.9	0.0	0.0	79.9	189.0	0.0
91-180	6.6	12.5	0.0	0.0	12.5	6.6	0.0
>180	7.6	23.6	0.0	0.0	23.6	7.6	0.0
Total	704.5	683.9	304.7	184.9	238.8	379.1	140.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11.8 %	3.8 %	3.7 %	4.7 %
15-35	3.8 %	3.9 %	3.6 %	3.9 %
36-60	-	3.6 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.4 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	2.6 %	3.1 %
>180	-	2.8 %	2.1 %	2.7 %
Total	6.6 %	3.7 %	3.4 %	3.9 %

*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	11 al 15 de diciembre				18 al 22 de diciembre				25 al 29 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	141	3901	4092	26	154	3469	3981	8	104	1612	2019
Intragruppo y off-shore***	0	0	1858	1019	0	0	2211	1635	0	0	1166	774
Otros	141	34	971	1620	154	26	529	594	104	8	283	269
Total	174	174	6730	6730	179	179	6210	6210	112	112	3062	3062

* 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.