

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 12 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\$1814.4 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	403.3	214.2	61.9	255.4	47.5	43.1	104.9
15-35	505.2	681.7	330.3	79.6	31.6	105.7	319.9
36-60	22.7	120.5	104.9	0.0	6.6	13.7	9.0
61-90	114.4	64.1	0.0	0.0	64.1	114.4	0.0
91-180	9.9	18.3	0.0	0.0	18.3	9.9	0.0
>180	25.9	87.8	15.0	0.0	52.8	5.9	20.0
Total	1081.5	1186.6	512.1	335.0	220.8	292.7	453.8

* 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	1.9 %	3.8 %	3.8 %	3.3 %
15-35	3.8 %	4.0 %	3.6 %	3.8 %
36-60	3.8 %	3.7 %	3.3 %	3.6 %
61-90	-	3.3 %	3.1 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.4 %	2.9 %
>180	2.7 %	3.0 %	2.0 %	2.8 %
Total	3.3 %	3.7 %	3.5 %	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	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**	41	144	4201	4195	20	157	3563	4054	10	105	1623	2049
Intragrupa y off-shore***	0	0	1903	1269	0	0	2228	1635	0	0	1191	779
Otros	144	41	992	1633	157	20	520	622	104	10	285	272
Total	185	185	7097	7097	177	177	6311	6311	114	114	3100	3100

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