

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 13 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\$1751.5 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	403.1	145.9	73.0	335.2	29.9	24.9	43.0
15-35	470.3	595.9	432.2	108.5	38.1	236.2	125.6
36-60	54.0	15.0	0.0	0.0	15.0	54.0	0.0
61-90	64.6	67.4	38.0	0.0	29.4	64.6	0.0
91-180	33.1	20.4	0.0	30.0	20.4	3.1	0.0
>180	30.0	30.5	0.0	20.0	20.5	0.0	10.0
Total	1055.1	875.1	543.2	493.7	153.3	382.8	178.6

* 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	-2.8 %	3.5 %	3.8 %	3.1 %
15-35	3.9 %	3.9 %	3.6 %	3.8 %
36-60	-	3.5 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	3.5 %	3.2 %	3.4 %
91-180	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
>180	2.8 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
Total	2.3 %	3.7 %	3.6 %	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**	39	145	4492	4217	22	163	3673	4160	10	105	1633	2060
Intragrupa y off-shore***	0	0	1913	1546	0	0	2283	1693	0	0	1199	779
Otros	145	39	992	1634	163	22	541	644	104	10	288	281
Total	184	184	7397	7397	185	185	6497	6497	114	114	3120	3120

* 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.