

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 14 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\$2273.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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 | 484.4 | 309.1 | 154.3 | 313.0 | 46.8 | 63.4 | 108.0 |
| 15-35 | 517.3 | 594.1 | 342.6 | 95.5 | 50.5 | 220.8 | 201.0 |
| 36-60 | 194.1 | 138.4 | 0.0 | 0.0 | 138.4 | 194.1 | 0.0 |
| 61-90 | 119.1 | 43.9 | 0.0 | 40.0 | 32.9 | 68.1 | 11.0 |
| 91-180 | 29.5 | 57.7 | 0.7 | 1.0 | 57.0 | 28.5 | 0.0 |
| >180 | 45.0 | 106.3 | 9.3 | 0.0 | 52.0 | 0.0 | 45.0 |
| Total | 1389.4 | 1249.5 | 506.9 | 449.5 | 377.6 | 574.9 | 365.0 |

* 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 | 3.6 % | 3.2 % | 3.3 % | 3.3 % |
| 15-35 | 3.1 % | 3.6 % | 3.4 % | 3.4 % |
| 36-60 | - | 3.2 % | 3.1 % | 3.2 % |
| 61-90 | 3.2 % | 3.4 % | 3.1 % | 3.2 % |
| 91-180 | - | 3.2 % | 2.7 % | 3.0 % |
| >180 | 2.7 % | 3.0 % | - | 2.8 % |
| Total | 3.1 % | 3.3 % | 3.3 % | 3.3 % |

*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 | 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** | 38 | 140 | 4692 | 4284 | 22 | 171 | 3843 | 4334 | 10 | 105 | 1748 | 2125 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1928 | 1699 | 0 | 0 | 2403 | 1789 | 0 | 0 | 1219 | 843 |
| Otros | 140 | 38 | 996 | 1633 | 171 | 22 | 546 | 669 | 104 | 10 | 324 | 322 |
| Total | 179 | 179 | 7616 | 7616 | 193 | 193 | 6792 | 6792 | 114 | 114 | 3290 | 3290 |

* 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.