

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 15 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\$870.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.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	110.0	95.2	52.5	69.0	20.7	19.0	22.0
15-35	406.9	309.9	91.5	121.9	29.9	96.5	188.5
36-60	2.7	5.4	0.0	0.0	5.4	2.7	0.0
61-90	4.6	61.9	31.5	0.0	30.4	4.6	0.0
91-180	3.1	20.9	0.0	0.0	20.9	3.1	0.0
>180	38.0	37.5	1.2	20.0	21.3	3.0	15.0
Total	565.2	530.8	176.7	210.9	128.6	128.8	225.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.7 %	3.0 %	2.7 %	3.0 %
15-35	3.5 %	3.7 %	3.4 %	3.5 %
36-60	-	4.1 %	3.3 %	3.9 %
61-90	-	3.2 %	2.9 %	3.2 %
91-180	-	3.2 %	2.6 %	3.1 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.6 %	2.7 %
Total	3.4 %	3.3 %	3.1 %	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	141	4692	4285	22	175	3941	4409	13	105	1757	2139
Intragrupa y off-shore***	0	0	1928	1699	0	0	2455	1858	0	0	1219	843
Otros	141	38	996	1633	175	22	551	680	105	13	332	326
Total	179	179	7616	7616	197	197	6948	6948	118	118	3308	3308

* 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.