

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 18 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\$1428.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	56.3	61.1	12.5	16.5	48.6	39.8	0.0
15-35	574.7	403.4	121.0	324.9	180.4	147.7	102.0
36-60	110.1	116.8	0.0	0.0	99.8	93.1	17.0
61-90	33.2	30.4	1.0	25.0	29.4	8.2	0.0
91-180	17.9	93.3	6.5	0.0	76.8	7.9	10.0
>180	36.7	39.6	5.2	20.0	18.5	0.7	16.0
Total	828.8	744.6	146.2	386.4	453.5	297.4	145.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	5.1 %	3.3 %	4.2 %
15-35	3.1 %	3.7 %	3.3 %	3.4 %
36-60	3.2 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
61-90	-	3.5 %	3.0 %	3.4 %
91-180	2.8 %	3.2 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.6 %	3.0 %	2.5 %	2.7 %
Total	3.0 %	3.7 %	3.2 %	3.4 %

*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	18 al 22 de diciembre				25 al 29 de diciembre				1 al 5 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	180	3971	4415	13	107	1777	2183	2	57	2223	2731
Intragruppo y off-shore***	0	0	2461	1872	0	0	1226	846	0	0	1480	987
Otros	180	26	552	696	107	13	370	344	57	2	162	147
Total	207	207	6984	6984	120	120	3373	3373	59	59	3865	3865

* 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.