

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 20 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\$1131.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.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	219.8	106.4	54.3	150.3	15.6	33.0	36.5
15-35	330.5	384.9	202.3	200.5	78.1	25.5	104.5
36-60	0.1	19.6	0.0	0.0	19.6	0.1	0.0
61-90	71.1	56.6	0.0	0.0	26.6	41.1	30.0
91-180	10.7	82.7	0.0	0.0	77.7	5.7	5.0
>180	4.0	21.2	0.0	0.0	21.2	4.0	0.0
Total	636.2	671.4	256.6	350.8	238.8	109.4	176.0

* 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	3.2 %	3.9 %	3.2 %	3.4 %
15-35	3.1 %	3.7 %	3.3 %	3.5 %
36-60	-	3.7 %	2.7 %	3.7 %
61-90	3.1 %	3.5 %	3.0 %	3.2 %
91-180	2.8 %	3.1 %	2.6 %	3.1 %
>180	-	3.0 %	2.5 %	2.9 %
Total	3.1 %	3.6 %	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

Sector	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**	28	204	4202	4566	14	104	1910	2282	2	56	2285	2772
Intragrupa y off-shore***	0	0	2514	2007	0	0	1277	913	0	0	1495	1027
Otros	204	28	561	704	103	14	388	381	56	2	168	149
Total	232	232	7276	7276	118	118	3575	3575	58	58	3949	3949

* 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.