

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 22 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\$501.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	63.8	48.4	24.0	40.0	14.4	13.8	10.0
15-35	54.7	102.5	75.8	20.0	21.7	29.7	5.0
36-60	18.9	17.9	0.0	10.2	10.9	1.7	7.0
61-90	35.0	77.0	30.0	0.0	13.0	1.0	34.0
91-180	35.3	74.2	35.6	30.0	35.7	2.3	3.0
>180	10.5	32.0	3.0	0.0	19.0	0.5	10.0
Total	218.2	352.0	168.3	100.2	114.6	48.9	69.0

* 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	3.3 %	4.7 %	3.1 %	3.7 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
36-60	3.1 %	3.6 %	2.9 %	3.4 %
61-90	-0.1 %	3.3 %	2.8 %	1.8 %
91-180	2.9 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.2 %	2.3 %	3.0 %
Total	1.5 %	3.4 %	3.1 %	3.0 %

* 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**	28	208	4234	4586	18	102	2028	2342	4	54	2377	2854
Intragruppo y off-shore***	0	0	2525	2029	0	0	1291	1004	0	0	1520	1070
Otros	208	28	561	704	102	18	419	393	54	4	199	172
Total	237	237	7319	7319	120	120	3739	3739	58	58	4096	4096

* 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.