

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 27 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\$1377.5 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	149.1	53.4	12.0	97.0	6.4	17.1	35.0
15-35	506.2	485.8	105.1	229.0	235.7	132.2	145.0
36-60	120.4	73.8	50.0	115.0	23.8	5.4	0.0
61-90	35.3	109.7	65.0	0.0	9.7	0.3	35.0
91-180	4.7	42.5	26.8	0.0	15.8	4.7	0.0
>180	6.8	4.9	0.0	0.0	4.9	6.8	0.0
Total	822.5	770.1	258.9	441.0	296.2	166.5	215.0

* 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 %	3.0 %	2.9 %	2.9 %
15-35	3.2 %	3.6 %	3.2 %	3.4 %
36-60	-	3.4 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.1 %	3.2 %	2.9 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	2.9 %	3.2 %
>180	-	3.2 %	2.3 %	2.6 %
Total	3.2 %	3.5 %	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.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de diciembre				1 al 5 de enero				8 al 12 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	106	2109	2403	15	54	2462	2900	5	101	2613	3602
Intragrupa y off-shore***	0	0	1312	1049	0	0	1544	1127	0	0	1884	560
Otros	106	20	424	393	54	15	199	178	101	5	463	798
Total	126	126	3845	3845	70	70	4206	4206	106	106	4960	4960

* 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.