

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2018

Fecha de Información: 28 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\$1298.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.6%.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	116.6	126.7	18.0	27.0	40.7	21.6	68.0
15-35	472.7	405.9	153.0	135.7	120.7	204.8	132.2
36-60	42.0	15.6	0.0	40.0	15.6	2.0	0.0
61-90	67.9	194.0	150.0	60.0	44.0	7.9	0.0
91-180	4.0	14.4	0.0	0.0	14.4	4.0	0.0
>180	15.3	23.3	15.0	0.0	8.3	15.3	0.0
Total	718.6	779.9	336.0	262.7	243.7	255.7	200.2

* 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 %	9.3 %	3.0 %	5.5 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.5 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	3.5 %	3.1 %	3.4 %
91-180	-	3.2 %	2.3 %	3.0 %
>180	-	2.8 %	2.3 %	2.6 %
Total	3.3 %	4.1 %	3.2 %	3.6 %

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. 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	17	55	2525	2978	13	107	2661	3702
Intragruppo y off-shore***	0	0	1312	1049	0	0	1549	1154	0	0	1917	560
Otros	106	20	424	393	55	17	240	181	107	13	495	812
Total	126	126	3846	3846	72	72	4314	4314	120	120	5074	5074

* 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.