

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 01 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\$1839.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	264.5	187.6	72.5	168.1	30.1	11.4	85.0
15-35	488.5	703.9	425.0	190.0	12.0	31.4	267.0
36-60	171.2	135.4	58.6	0.0	76.7	171.1	0.0
61-90	82.6	141.4	75.0	0.0	31.4	47.6	35.0
91-180	0.8	12.7	0.0	0.0	12.7	0.8	0.0
>180	14.8	33.4	0.0	0.0	23.4	4.8	10.0
Total	1022.3	1214.4	631.1	358.1	186.3	267.2	397.0

* 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	3.8 %	3.7 %	3.8 %	3.7 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.7 %	3.7 %
36-60	3.9 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
61-90	3.0 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.6 %	3.1 %
>180	2.6 %	3.1 %	2.0 %	2.9 %
Total	3.6 %	3.5 %	3.4 %	3.5 %

*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	27 de nov. al 1 de diciembre				4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	201	6043	5881	20	125	4091	4261	20	135	3369	3563
Intragruppo y off-shore***	0	0	2615	2066	0	0	2150	1248	0	0	1615	815
Otros	201	23	1503	2214	125	20	839	1571	135	20	930	1536
Total	223	223	10160	10160	145	145	7080	7080	155	155	5914	5914

* 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 intragrupo.