

Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 05 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\$1904.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.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	364.2	304.5	181.9	220.3	12.6	34.0	110.0
15-35	331.7	521.2	339.5	141.0	11.7	20.7	170.0
36-60	79.1	31.8	9.0	0.0	21.8	78.1	1.0
61-90	293.6	195.0	21.6	0.0	133.4	253.6	40.0
91-180	84.1	6.9	0.0	80.9	6.9	3.2	0.0
>180	0.0	13.0	0.0	0.0	13.0	0.0	0.0
Total	1152.7	1072.3	552.0	442.2	199.4	389.6	321.0

* 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	3.9 %	4.6 %	3.3 %	3.8 %
15-35	3.8 %	3.7 %	3.7 %	3.7 %
36-60	3.7 %	3.4 %	3.2 %	3.2 %
61-90	2.9 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.3 %	3.1 %	3.1 %
>180	-	2.7 %	-	2.7 %
Total	3.7 %	3.7 %	3.2 %	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

Sector	4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre				18 al 22 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	134	4624	4420	23	136	3528	3819	20	152	3066	3517
Intragrupa y off-shore***	0	0	2181	1651	0	0	1739	829	0	0	1946	1484
Otros	134	18	861	1595	136	23	946	1565	152	20	487	499
Total	152	152	7666	7666	159	159	6213	6213	172	172	5499	5499

* 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.