

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 06 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\$2095.1 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	224.5	172.5	73.0	96.8	22.5	50.8	77.0
15-35	672.1	815.4	422.0	283.2	17.5	13.1	375.9
36-60	83.8	121.2	69.0	0.0	52.2	83.8	0.0
61-90	272.1	78.3	0.0	10.0	43.3	227.1	35.0
91-180	18.2	32.0	25.0	10.0	7.0	8.2	0.0
>180	37.3	55.6	35.0	35.0	20.6	2.3	0.0
Total	1308.0	1274.9	624.0	434.9	163.0	385.3	487.9

* 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	3.7 %	3.9 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.7 %	3.6 %	3.6 %	3.7 %
36-60	-	3.5 %	3.3 %	3.4 %
61-90	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.0 %	2.8 %	2.9 %
>180	-	2.8 %	2.7 %	2.8 %
Total	3.7 %	3.5 %	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	135	4725	4450	32	136	3596	3887	25	152	3200	3614
Intragrupa y off-shore***	0	0	2191	1726	0	0	1772	841	0	0	1978	1563
Otros	135	18	861	1601	136	32	954	1595	152	25	498	500
Total	153	153	7777	7777	168	168	6322	6322	177	177	5676	5676

* 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.