

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 07 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\$1668.3 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	283.6	390.1	209.5	99.0	29.1	33.1	151.5
15-35	299.0	513.4	266.5	40.0	28.4	40.5	218.5
36-60	17.9	7.3	0.0	0.0	7.3	17.9	0.0
61-90	205.1	252.5	80.0	0.0	132.5	165.1	40.0
91-180	19.9	22.0	0.0	0.0	22.0	19.9	0.0
>180	38.3	44.1	5.0	20.0	24.1	3.3	15.0
Total	863.7	1229.5	561.0	159.0	243.5	279.7	425.0

* 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 %	2.9 %	2.7 %	3.1 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.5 %	3.7 %
36-60	-	3.6 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.1 %	2.7 %	2.9 %
>180	2.7 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %
Total	3.7 %	3.3 %	3.0 %	3.3 %

*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	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	4729	4462	33	134	3761	4036	25	152	3324	3859
Intragrupa y off-shore***	0	0	2191	1726	0	0	1814	896	0	0	2148	1607
Otros	134	18	873	1605	134	33	975	1618	152	25	503	510
Total	152	152	7793	7793	168	168	6550	6550	178	178	5975	5975

* 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.