

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2018

Fecha de Información: 05 de enero de 2018 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\$893.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	154.3	131.7	82.5	109.0	12.2	8.3	37.0
15-35	340.2	313.9	140.0	185.2	26.9	8.0	147.0
36-60	1.0	13.0	0.0	0.0	13.0	1.0	0.0
61-90	2.0	16.7	0.0	0.0	16.7	2.0	0.0
91-180	0.5	32.1	3.0	0.0	29.1	0.5	0.0
>180	34.0	68.3	0.0	0.0	38.3	4.0	30.0
Total	532.0	575.7	225.5	294.2	136.2	23.8	214.0

* 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	3.0 %	3.4 %	2.9 %	3.1 %
15-35	3.1 %	3.2 %	2.9 %	3.1 %
36-60	-	3.7 %	3.1 %	3.7 %
61-90	-	3.5 %	2.8 %	3.5 %
91-180	-	3.4 %	2.8 %	3.4 %
>180	2.7 %	3.1 %	2.4 %	2.9 %
Total	3.0 %	3.3 %	2.9 %	3.1 %

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	1 al 5 de enero				8 al 12 de enero				15 al 19 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	57	3071	3161	17	115	3091	4021	33	89	3824	3430
Intragruppo y off-shore***	0	0	1601	1571	0	0	2007	765	0	0	1304	1202
Otros	57	13	258	198	115	17	540	851	89	33	1026	1521
Total	70	70	4930	4930	132	132	5638	5638	122	122	6154	6154

* 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.