

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2018

Fecha de Información: 11 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\$1984.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	279.5	221.7	143.2	202.0	29.5	28.5	49.0
15-35	795.4	649.7	319.0	206.5	144.2	402.4	186.5
36-60	17.3	31.0	0.0	0.0	31.0	17.3	0.0
61-90	3.0	34.1	0.0	0.0	34.0	2.9	0.1
91-180	0.6	66.9	0.0	0.0	66.7	0.4	0.2
>180	65.0	70.7	0.0	50.0	55.7	0.0	15.0
Total	1160.8	1074.1	462.2	458.5	361.2	451.5	250.8

* 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	3.2 %		2.7 %	3.2 %	3.0 %
15-35	3.1 %		3.3 %	3.0 %	3.1 %
36-60	-		3.8 %	3.0 %	3.5 %
61-90	3.2 %		3.7 %	2.9 %	3.6 %
91-180	3.2 %		3.4 %	2.7 %	3.4 %
>180	2.8 %		3.0 %	2.9 %	3.0 %
Total	3.1 %		3.2 %	3.0 %	3.1 %

*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	8 al 12 de enero				15 al 19 de enero				22 al 26 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	120	3814	4139	36	94	4025	3658	13	112	2484	2562
Intragrupo y off-shore***	0	0	2114	1453	0	0	1435	1323	0	0	681	530
Otros	120	17	535	872	94	36	1067	1545	112	13	1126	1198
Total	137	137	6463	6463	130	130	6526	6526	124	124	4291	4291

* 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.