

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2018

Fecha de Información: 12 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\$2624.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	334.2	312.4	153.5	162.1	28.9	42.2	130.0
15-35	783.0	764.6	301.6	375.8	95.3	39.5	367.7
36-60	50.0	116.3	0.0	0.0	116.3	50.0	0.0
61-90	26.6	17.7	1.0	20.0	16.7	6.6	0.0
91-180	60.2	98.6	0.2	0.0	38.4	0.2	60.0
>180	320.9	495.6	238.0	105.0	59.3	17.6	198.3
Total	1575.0	1805.2	694.2	662.9	355.0	156.1	756.0

* 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	3.2 %	3.9 %	3.1 %	3.5 %
15-35	3.3 %	3.3 %	3.1 %	3.3 %
36-60	3.4 %	3.2 %	3.0 %	3.2 %
61-90	-	3.7 %	3.2 %	3.4 %
91-180	3.0 %	3.6 %	3.0 %	3.3 %
>180	2.8 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
Total	3.1 %	3.5 %	3.1 %	3.2 %

* 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**	16	120	3817	4139	36	97	4230	3905	13	112	2612	2622
Intragrupo y off-shore***	0	0	2114	1453	0	0	1578	1416	0	0	691	600
Otros	120	16	536	875	97	36	1071	1557	112	13	1145	1227
Total	136	136	6467	6467	133	133	6879	6879	124	124	4449	4449

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