

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2018

Fecha de Información: 16 de enero de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2468.0 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 | 560.1 | 492.1 | 97.0 | 168.4 | 24.1 | 20.6 | 371.0 |
| 15-35 | 693.9 | 561.2 | 211.0 | 161.3 | 38.2 | 220.7 | 312.0 |
| 36-60 | 258.6 | 215.5 | 0.0 | 0.0 | 209.5 | 252.6 | 6.0 |
| 61-90 | 29.3 | 17.6 | 0.0 | 20.0 | 16.6 | 8.3 | 1.0 |
| 91-180 | 1.2 | 30.6 | 0.0 | 0.0 | 29.6 | 0.2 | 1.0 |
| >180 | 277.6 | 266.2 | 4.3 | 30.5 | 16.9 | 2.1 | 245.0 |
| Total | 1820.8 | 1583.3 | 312.3 | 380.2 | 335.0 | 504.6 | 936.0 |

* 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 | |
| 3-14 | 3.3 % | 4.2 % | 3.2 % | 3.5 % |
| 15-35 | 3.3 % | 3.4 % | 3.1 % | 3.3 % |
| 36-60 | 3.4 % | 3.1 % | 3.0 % | 3.1 % |
| 61-90 | 3.2 % | 3.5 % | 3.1 % | 3.2 % |
| 91-180 | 3.1 % | 3.3 % | 1.3 % | 3.3 % |
| >180 | 2.9 % | 3.1 % | 2.9 % | 2.9 % |
| Total | 3.2 % | 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 | 15 al 19 de enero | | | | 22 al 26 de enero | | | | 29 de ene. al 2 de febrero | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|----------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 22 | 103 | 4957 | 4510 | 25 | 113 | 2810 | 2793 | 6 | 97 | 3814 | 3789 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1871 | 1827 | 0 | 0 | 704 | 645 | 0 | 0 | 1332 | 1248 |
| Otros | 103 | 22 | 1068 | 1559 | 113 | 25 | 1164 | 1241 | 97 | 6 | 1608 | 1716 |
| Total | 125 | 125 | 7896 | 7896 | 139 | 139 | 4678 | 4678 | 103 | 103 | 6753 | 6753 |

* 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.