

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2018

Fecha de Información: 16 de enero de 2018 <sup>1</sup>

## 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%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo 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
<b>Total</b>	<b>1820.8</b>	<b>1583.3</b>	<b>312.3</b>	<b>380.2</b>	<b>335.0</b>	<b>504.6</b>	<b>936.0</b>

\* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	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 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>3.2 %</b>

\*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
<b>Sector Financiero**</b>	22	103	4957	4510	25	113	2810	2793	6	97	3814	3789
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1871	1827	0	0	704	645	0	0	1332	1248
<b>Otros</b>	103	22	1068	1559	113	25	1164	1241	97	6	1608	1716
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>7896</b>	<b>7896</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4678</b>	<b>4678</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>6753</b>	<b>6753</b>

\* 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.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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 intragruppo.