

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2018

Fecha de Información: 18 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\$2129.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	282.2	212.9	41.2	136.0	56.7	31.2	115.0
15-35	531.3	544.0	285.3	186.8	173.7	259.6	85.0
36-60	264.7	196.4	50.0	2.6	146.4	262.1	0.0
61-90	11.3	24.7	0.0	0.0	23.7	10.3	1.0
91-180	126.7	44.6	0.0	120.0	38.6	0.7	6.0
>180	73.3	49.0	0.0	40.0	24.0	8.3	25.0
Total	1289.5	1071.6	376.5	485.4	463.1	572.1	232.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.3 %	2.9 %	3.2 %	3.2 %
15-35	3.2 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %
36-60	-	3.4 %	3.2 %	3.3 %
61-90	3.3 %	3.6 %	3.4 %	3.5 %
91-180	3.2 %	3.6 %	3.2 %	3.3 %
>180	2.9 %	3.2 %	2.9 %	3.0 %
Total	3.2 %	3.3 %	3.2 %	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	101	5195	4625	26	116	3021	3075	29	100	3913	3898
Intragruppo y off-shore***	0	0	1902	1972	0	0	784	674	0	0	1364	1295
Otros	101	22	1067	1567	116	26	1214	1271	100	29	1635	1719
Total	124	124	8164	8164	142	142	5020	5020	128	128	6912	6912

* 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 intragruppo.