

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2018

Fecha de Información: 22 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\$1625.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	281.6	241.2	75.0	99.0	7.2	23.6	159.0
15-35	571.0	538.2	162.0	115.0	23.7	103.5	352.5
36-60	277.7	162.5	0.0	0.0	162.5	277.7	0.0
61-90	25.4	24.7	0.0	0.0	4.7	5.4	20.0
91-180	2.7	18.1	0.0	0.0	18.1	2.7	0.0
>180	1.7	11.8	0.0	0.0	11.8	1.7	0.0
<b>Total</b>	<b>1160.0</b>	<b>996.5</b>	<b>237.0</b>	<b>214.0</b>	<b>228.0</b>	<b>414.5</b>	<b>531.5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.2 %	3.4 %	2.3 %	3.0 %
15-35	3.1 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %
36-60	-	3.3 %	3.2 %	3.2 %
61-90	3.1 %	3.8 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.5 %	3.0 %	3.4 %
>180	-	3.5 %	2.8 %	3.4 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.3 %</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.1 %</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	22 al 26 de enero				29 de ene. al 2 de febrero				5 al 9 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	114	3448	3402	30	101	4224	4253	3	93	4408	3716
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	928	881	0	0	1511	1329	0	0	1377	1140
<b>Otros</b>	114	26	1219	1311	101	30	1712	1866	93	3	1143	2072
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>5595</b>	<b>5595</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>7448</b>	<b>7448</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>6928</b>	<b>6928</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.