

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1378.5 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	215.9	142.6	57.8	103.0	19.8	47.9	65.0
15-35	396.4	363.4	153.9	92.8	40.0	134.1	169.5
36-60	237.4	187.1	10.0	0.0	157.1	217.4	20.0
61-90	36.9	23.1	5.0	20.0	8.1	6.9	10.0
91-180	1.2	27.2	0.0	0.0	27.2	1.2	0.0
>180	5.2	11.5	0.0	0.0	6.5	0.2	5.0
Total	893.1	755.0	226.7	215.8	258.8	407.8	269.5

* 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 %	3.1 %	3.2 %
15-35	3.2 %	3.7 %	3.0 %	3.3 %
36-60	3.1 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.2 %	3.5 %	3.1 %	3.2 %
91-180	-	3.3 %	2.7 %	3.2 %
>180	2.9 %	3.5 %	2.4 %	3.2 %
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	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
Sector Financiero**	26	118	3576	3439	30	104	4311	4332	3	94	4414	3721
Intragrupo y off-shore***	0	0	968	981	0	0	1529	1332	0	0	1377	1140
Otros	118	26	1197	1321	104	30	1727	1904	94	3	1148	2077
Total	144	144	5742	5742	134	134	7567	7567	97	97	6939	6939

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