

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1378.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa 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
<b>Total</b>	<b>893.1</b>	<b>755.0</b>	<b>226.7</b>	<b>215.8</b>	<b>258.8</b>	<b>407.8</b>	<b>269.5</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 %	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 %
<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

Sector	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
Intragrupa 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
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5742</b>	<b>5742</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>7567</b>	<b>7567</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>6939</b>	<b>6939</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 intragrupo.