

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1554.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	211.4	81.8	37.0	149.0	22.7	40.3	22.0
15-35	687.2	536.6	174.8	391.0	147.4	81.7	214.5
36-60	78.1	84.1	0.0	15.0	34.1	13.1	50.0
61-90	49.7	48.4	0.0	15.0	18.4	4.7	30.0
91-180	2.5	17.9	0.0	0.0	17.9	2.5	0.0
>180	50.9	52.7	0.0	20.0	22.7	0.9	30.0
Total	1079.8	821.6	211.8	590.0	263.2	143.3	346.5

* 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	
3-14	2.2 %	3.2 %	2.6 %	2.7 %
15-35	2.5 %	2.0 %	2.4 %	2.3 %
36-60	2.6 %	3.0 %	2.5 %	2.7 %
61-90	2.7 %	3.2 %	2.8 %	2.9 %
91-180	-	3.4 %	2.7 %	3.3 %
>180	2.7 %	3.2 %	2.7 %	2.9 %
Total	2.5 %	2.4 %	2.5 %	2.5 %

*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**	27	116	3933	3324	34	109	4860	4208	3	99	4613	3778
Intragrupo y off-shore***	0	0	990	1302	0	0	1614	1622	0	0	1382	1236
Otros	116	27	1032	1329	109	34	1406	2050	99	3	1158	2139
Total	143	143	5956	5956	143	143	7880	7880	103	103	7153	7153

* 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 intragrupo.