Fecha de Publicación: 12 de enero de 2018

Fecha de Información: 10 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$2284.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.[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	549.8	189.4	96.0	467.8	24.4	13.0	69.0
15-35	525.9	1118.4	766.8	193.5	57.3	38.1	294.3
36-60	36.6	40.2	0.0	0.0	15.2	11.6	25.0
61-90	120.5	73.0	0.0	60.0	13.0	0.5	60.0
91-180	0.2	32.7	0.0	0.0	32.7	0.2	0.0
>180	27.7	38.3	0.0	8.0	18.6	0.0	19.7
Total	**1260.6**	**1492.1**	**862.8**	**729.3**	**161.3**	**63.3**	**468.0**

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.1 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
15-35	3.1 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
36-60	3.2 %	3.6 %	3.1 %	3.3 %
61-90	3.0 %	3.6 %	2.9 %	3.1 %
91-180	-	3.3 %	2.5 %	3.3 %
>180	2.6 %	3.0 %	2.8 %	2.8 %
Total	3.1 %	3.1 %	3.1 %	3.1 %

*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	8 al 12 de enero				15 al 19 de enero				22 al 26 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	120	3702	4105	34	92	3893	3559	13	111	2440	2471
Intragrupo y off-shore***	0	0	2071	1342	0	0	1395	1232	0	0	621	530
Otros	120	18	545	871	92	34	1044	1540	111	13	1111	1171
Total	**137**	**137**	**6318**	**6318**	**126**	**126**	**6332**	**6332**	**123**	**123**	**4173**	**4173**

* 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.