Fecha de Publicación: 17 de enero de 2018

Fecha de Información: 15 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$1294.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.[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	390.7	296.0	211.0	302.8	2.0	4.9	83.0
15-35	329.5	125.8	3.0	215.0	8.8	0.5	114.0
36-60	0.0	15.3	2.0	0.0	13.3	0.0	0.0
61-90	0.1	10.8	2.0	0.0	8.8	0.1	0.0
91-180	0.0	15.0	2.0	0.0	13.0	0.0	0.0
>180	0.0	308.6	299.6	0.0	9.0	0.0	0.0
Total	**720.3**	**771.6**	**519.6**	**517.8**	**55.0**	**5.5**	**197.0**

* 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	3.3 %	3.8 %	2.2 %	3.3 %
15-35	3.2 %	4.7 %	3.0 %	3.3 %
36-60	-	4.1 %	2.5 %	4.1 %
61-90	-	3.7 %	3.0 %	3.7 %
91-180	-	3.9 %	-	3.9 %
>180	-	3.5 %	-	3.5 %
Total	3.2 %	3.9 %	2.9 %	3.4 %

*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	15 al 19 de enero				22 al 26 de enero				29 de ene. al 2 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	101	4616	4196	14	113	2617	2623	6	97	3778	3778
Intragrupo y off-shore***	0	0	1789	1719	0	0	691	600	0	0	1327	1233
Otros	101	33	1068	1557	113	14	1146	1232	97	6	1602	1695
Total	**135**	**135**	**7472**	**7472**	**127**	**127**	**4454**	**4454**	**103**	**103**	**6706**	**6706**

* 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.