Fecha de Publicación: 19 de enero de 2018

Fecha de Información: 17 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$2241.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.[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	270.7	268.7	86.5	84.5	25.7	29.7	156.5
15-35	594.4	549.2	183.3	143.8	78.4	163.1	287.5
36-60	368.5	361.3	30.0	0.0	171.3	208.5	160.0
61-90	57.0	66.6	10.0	20.0	21.6	2.0	35.0
91-180	40.2	73.9	0.0	0.0	33.9	0.2	40.0
>180	245.0	184.9	9.0	75.0	15.9	10.0	160.0
Total	**1575.8**	**1504.5**	**318.8**	**323.3**	**346.8**	**413.5**	**839.0**

* 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 %	3.5 %	3.4 %	3.4 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
36-60	3.5 %	3.5 %	3.2 %	3.4 %
61-90	3.2 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.2 %	3.5 %	3.0 %	3.3 %
>180	3.0 %	3.1 %	3.0 %	3.0 %
Total	3.3 %	3.4 %	3.2 %	3.3 %

*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**	22	103	5103	4584	26	114	2898	2955	29	99	3845	3832
Intragrupo y off-shore***	0	0	1877	1897	0	0	784	659	0	0	1332	1249
Otros	103	22	1067	1565	114	26	1174	1243	99	29	1620	1716
Total	**125**	**125**	**8047**	**8047**	**139**	**139**	**4857**	**4857**	**128**	**128**	**6797**	**6797**

* 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.