Fecha de Publicación: 23 de enero de 2018

Fecha de Información: 19 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$1412.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.[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	456.1	443.3	216.0	142.0	77.3	164.1	150.0
15-35	303.3	284.4	130.8	188.0	56.7	18.3	97.0
36-60	52.1	63.8	0.0	0.0	63.8	52.1	0.0
61-90	4.4	10.7	0.0	0.0	10.7	4.4	0.0
91-180	10.1	18.1	0.0	10.0	18.1	0.1	0.0
>180	3.8	9.3	0.0	3.8	9.3	0.0	0.0
Total	**829.8**	**829.6**	**346.8**	**343.8**	**235.8**	**239.0**	**247.0**

* 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	3.2 %	2.9 %	3.2 %	3.1 %
15-35	3.2 %	3.4 %	3.2 %	3.2 %
36-60	-	3.2 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	5.0 %	3.1 %	4.4 %
91-180	-	4.1 %	2.9 %	4.1 %
>180	-	3.6 %	2.9 %	3.4 %
Total	3.2 %	3.2 %	3.1 %	3.2 %

*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	5195	4625	26	117	3231	3239	29	99	4161	4178
Intragrupo y off-shore***	0	0	1902	1972	0	0	883	796	0	0	1481	1315
Otros	103	22	1067	1567	117	26	1220	1299	99	29	1707	1857
Total	**125**	**125**	**8164**	**8164**	**143**	**143**	**5334**	**5334**	**128**	**128**	**7349**	**7349**

* 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.