Fecha de Publicación: 26 de enero de 2018

Fecha de Información: 24 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$1644.0 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	437.6	154.1	35.2	320.8	31.9	29.7	87.0
15-35	442.1	407.0	195.6	143.7	100.4	187.4	111.0
36-60	77.8	104.9	0.0	0.0	79.9	52.8	25.0
61-90	46.7	78.9	2.4	0.0	31.5	1.7	45.0
91-180	8.3	121.1	58.7	0.0	61.8	7.7	0.6
>180	0.0	34.2	0.0	0.0	34.2	0.0	0.0
Total	**1012.5**	**900.1**	**292.0**	**464.5**	**339.6**	**279.3**	**268.6**

* 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	2.8 %	3.7 %	3.0 %	3.1 %
15-35	3.1 %	3.5 %	2.9 %	3.1 %
36-60	3.1 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.0 %	3.5 %	2.9 %	3.2 %
91-180	3.3 %	3.4 %	3.0 %	3.4 %
>180	-	3.3 %	2.9 %	3.3 %
Total	3.0 %	3.5 %	2.9 %	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	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	119	3814	3311	31	108	4467	4043	3	97	4502	3735
Intragrupo y off-shore***	0	0	983	1184	0	0	1549	1424	0	0	1377	1174
Otros	119	27	1026	1328	108	31	1373	1922	97	3	1148	2118
Total	**146**	**146**	**5823**	**5823**	**138**	**138**	**7389**	**7389**	**100**	**100**	**7027**	**7027**

* 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.