Fecha de Publicación: 29 de enero de 2018

Fecha de Información: 25 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$2469.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.[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	350.3	142.3	35.5	179.6	33.8	97.7	73.0
15-35	1066.7	617.0	246.8	398.0	52.2	350.7	318.0
36-60	179.8	119.0	10.0	0.4	44.0	114.4	65.0
61-90	4.1	39.6	0.0	0.3	39.6	3.8	0.0
91-180	137.8	109.3	0.0	40.9	109.3	96.8	0.0
>180	70.2	154.2	30.1	0.0	59.1	5.2	65.0
Total	**1808.9**	**1181.4**	**322.3**	**619.2**	**338.1**	**668.6**	**521.0**

* 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	2.6 %	4.0 %	3.0 %	3.0 %
15-35	2.8 %	3.0 %	2.9 %	2.9 %
36-60	3.0 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
61-90	-	3.4 %	2.9 %	3.4 %
91-180	-	3.2 %	2.8 %	3.0 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.6 %	3.0 %
Total	2.8 %	3.2 %	2.9 %	2.9 %

*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	116	3925	3323	31	108	4660	4138	3	98	4604	3771
Intragrupo y off-shore***	0	0	990	1302	0	0	1577	1473	0	0	1382	1236
Otros	116	27	1031	1321	108	31	1396	2020	98	3	1151	2130
Total	**143**	**143**	**5947**	**5947**	**139**	**139**	**7632**	**7632**	**101**	**101**	**7136**	**7136**

* 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.