

Fecha de Publicación: 4 de enero de 2018

Fecha de Información: 02 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\$1195.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	345.3	100.0	20.0	255.5	15.5	25.3	64.5
15-35	328.9	377.2	222.3	222.0	106.4	58.4	48.5
36-60	16.7	22.1	2.0	4.4	20.1	12.3	0.0
61-90	21.2	21.6	2.0	20.0	19.6	1.2	0.0
91-180	4.9	50.9	0.0	0.0	47.2	1.2	3.7
>180	2.5	20.3	0.0	0.0	20.3	2.5	0.0
Total	719.5	592.2	246.3	501.9	229.2	100.9	116.7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.9 %	4.7 %	4.0 %	4.0 %
15-35	3.3 %	3.5 %	3.2 %	3.4 %
36-60	-	3.9 %	3.0 %	3.5 %
61-90	-	3.5 %	3.0 %	3.3 %
91-180	3.1 %	3.4 %	2.7 %	3.3 %
>180	-	2.9 %	2.1 %	2.8 %
Total	3.6 %	3.5 %	3.5 %	3.5 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	1 al 5 de enero				8 al 12 de enero				15 al 19 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	56	2773	3064	13	112	2757	3710	32	86	3436	3057
Intragrupa y off-shore***	0	0	1569	1334	0	0	1917	636	0	0	1286	1134
Otros	56	17	240	185	112	13	503	832	86	32	983	1514
Total	73	73	4583	4583	126	126	5178	5178	118	118	5705	5705

* 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.