

Fecha de Publicación: 5 de enero de 2018

Fecha de Información: 03 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\$1747.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	438.4	254.1	17.0	232.5	42.6	11.4	194.5
15-35	632.3	628.8	245.5	347.1	114.3	16.3	269.0
36-60	73.2	24.4	0.0	0.0	24.4	73.2	0.0
61-90	10.4	22.5	0.0	10.0	22.5	0.4	0.0
91-180	29.8	80.2	1.1	19.7	69.1	0.1	10.0
>180	0.0	26.6	0.0	0.0	26.6	0.0	0.0
Total	1184.1	1036.5	263.6	609.3	299.4	101.3	473.5

* 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 %	3.8 %	3.4 %	3.3 %
15-35	3.2 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
36-60	-	3.7 %	3.0 %	3.2 %
61-90	-	3.7 %	3.0 %	3.5 %
91-180	2.8 %	3.3 %	2.9 %	3.2 %
>180	-	2.8 %	2.6 %	2.8 %
Total	3.2 %	3.4 %	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

Sector	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	C	V						
Sector Financiero**	17	57	3044	3140	14	115	2838	3792	32	88	3576	3212								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1586	1550	0	0	1917	646	0	0	1286	1140								
Otros	57	17	252	192	115	14	524	841	88	32	1003	1513								
Total	74	74	4882	4882	129	129	5279	5279	120	120	5865	5865								

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