

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2018

Fecha de Información: 29 de enero de 2018 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1829.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	179.3	79.7	17.0	86.5	7.2	37.3	55.5
15-35	765.7	485.0	166.2	214.6	93.8	326.1	225.0
36-60	356.0	252.1	0.0	25.0	163.6	242.5	88.5
61-90	36.1	40.7	0.0	10.0	20.7	6.1	20.0
91-180	4.6	11.1	0.0	0.0	11.1	4.6	0.0
>180	0.3	8.4	0.0	0.0	8.4	0.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1341.9</b>	<b>877.0</b>	<b>183.2</b>	<b>336.1</b>	<b>304.8</b>	<b>616.8</b>	<b>389.0</b>

\* 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	2.2 %	2.8 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
36-60	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
61-90	2.7 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %
91-180	-	3.6 %	2.5 %	3.3 %
>180	-	3.4 %	2.3 %	3.3 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.6 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.4 %</b>

\*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	29 de ene. al 2 de febrero				5 al 9 de febrero				12 al 16 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	46	111	5002	4253	9	99	4632	3798	13	134	4390	3786
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1631	1709	0	0	1382	1236	0	0	1051	1310
<b>Otros</b>	111	46	1394	2065	99	9	1163	2143	134	13	1127	1471
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>8026</b>	<b>8026</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>7177</b>	<b>7177</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>6568</b>	<b>6568</b>

\* 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.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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 intragruppo.