

Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2018

Fecha de Información: 30 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\$1948.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.<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	182.5	143.2	83.8	92.6	8.8	39.3	50.6
15-35	546.0	705.8	360.0	257.4	166.3	109.2	179.5
36-60	162.2	7.5	0.0	150.0	7.5	12.2	0.0
61-90	188.4	56.0	0.0	70.0	46.0	108.4	10.0
91-180	10.7	18.0	0.0	0.0	12.3	5.0	5.7
>180	136.7	57.2	30.0	29.6	7.2	87.1	20.0
<b>Total</b>	<b>1226.5</b>	<b>987.6</b>	<b>473.8</b>	<b>599.5</b>	<b>248.0</b>	<b>361.1</b>	<b>265.8</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	1.8 %	1.9 %	2.1 %	2.0 %
15-35	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.7 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.6 %	3.4 %	2.6 %	2.8 %
91-180	2.7 %	3.1 %	2.4 %	2.9 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.6 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.4 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.3 %</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
Sector Financiero**	46	111	5071	4365	14	98	4722	3830	13	134	4446	3843
Intragruppo y off-shore***	0	0	1714	1749	0	0	1382	1284	0	0	1063	1315
Otros	111	46	1397	2069	98	14	1169	2159	134	13	1152	1503
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>8183</b>	<b>8183</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>7273</b>	<b>7273</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>6661</b>	<b>6661</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.