

Fecha de Publicación: 2 de febrero de 2018

Fecha de Información: 31 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\$2219.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	414.1	188.6	69.6	301.7	73.0	66.4	46.0
15-35	611.8	731.9	336.0	250.0	83.3	49.3	312.5
36-60	125.8	130.0	0.0	0.0	79.5	75.3	50.5
61-90	108.3	60.4	10.0	60.0	30.4	28.3	20.0
91-180	6.1	22.0	0.0	0.0	21.0	5.1	1.0
>180	127.7	213.0	120.0	35.0	3.0	2.7	90.0
Total	1393.7	1345.9	535.6	646.7	290.3	227.0	520.0

* 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	1.4 %	2.5 %	2.4 %	2.3 %
15-35	1.6 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
36-60	2.1 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
61-90	2.5 %	2.8 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.7 %	3.1 %	3.3 %	3.1 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.7 %	2.6 %
Total	1.9 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %

* 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

Sectores	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	113	5269	4448	14	99	4806	3883	13	137	4609	3928
Intragrupa y off-shore***	0	0	1764	1912	0	0	1402	1332	0	0	1071	1405
Otros	113	46	1400	2073	99	14	1187	2180	137	13	1204	1550
Total	159	159	8433	8433	113	113	7395	7395	150	150	6883	6883

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