

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2018

Fecha de Información: 01 de febrero 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\$2466.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	145.4	146.2	65.5	79.5	49.7	34.9	31.0
15-35	578.5	710.4	275.0	141.3	218.4	220.2	217.0
36-60	194.4	159.8	0.0	0.0	159.8	194.4	0.0
61-90	237.0	129.9	0.1	90.0	104.9	122.0	25.0
91-180	171.1	180.0	0.1	20.0	33.0	4.1	147.0
>180	124.6	139.1	91.0	45.0	18.1	49.6	30.0
Total	1451.0	1465.5	431.7	375.8	583.8	625.3	450.0

* 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	0.5 %	1.7 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.6 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.8 %	2.3 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.8 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %

*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**	47	115	5315	4493	14	95	4821	3961	13	137	4698	3948
Intragruppo y off-shore***	0	0	1776	1926	0	0	1452	1332	0	0	1074	1470
Otros	115	47	1406	2078	95	14	1215	2195	137	13	1216	1569
Total	162	162	8497	8497	109	109	7488	7488	150	150	6987	6987

* 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.