

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2018

Fecha de Información: 02 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\$1489.0 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	279.3	294.2	177.2	102.2	14.5	74.7	102.5
15-35	377.0	588.2	328.3	157.8	66.9	26.2	193.0
36-60	15.1	1.1	0.0	0.5	1.1	14.6	0.0
61-90	105.6	18.5	0.0	90.0	13.5	10.6	5.0
91-180	7.5	6.1	0.0	1.0	6.1	6.5	0.0
>180	75.0	66.8	20.0	30.0	1.8	0.0	45.0
Total	859.6	975.0	525.5	381.4	104.0	132.6	345.5

* 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	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.8 %	1.9 %	2.0 %
61-90	2.3 %	2.7 %	2.3 %	2.3 %
91-180	-	2.9 %	2.2 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.5 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.0 %	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	4492	22	97	5010	4190	25	136	4769	4015
Intragruppo y off-shore***	0	0	1776	1926	0	0	1608	1424	0	0	1094	1480
Otros	115	47	1406	2078	97	22	1221	2225	136	25	1227	1595
Total	162	162	8497	8497	119	119	7840	7840	161	161	7090	7090

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.