

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2018

Fecha de Información: 05 de febrero de 2018 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS²

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1961.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.³

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	118.9	214.4	128.0	21.5	29.4	40.4	57.0
15-35	584.0	350.1	85.5	341.8	95.6	73.3	169.0
36-60	336.8	282.2	1.0	8.0	221.2	268.8	60.0
61-90	42.1	88.0	10.0	0.0	38.0	2.1	40.0
91-180	62.3	56.2	0.0	0.0	56.2	62.3	0.0
>180	150.0	2.5	0.0	0.0	2.5	150.0	0.0
Total	1294.0	993.4	224.5	371.3	442.9	596.8	326.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.9 %	1.4 %	1.8 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
36-60	2.3 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	2.5 %	1.9 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	2.7 %	2.5 %	2.6 %
>180	-	3.4 %	2.4 %	2.4 %
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

Sector	5 al 9 de febrero				12 al 16 de febrero				19 al 23 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	95	5156	4429	22	138	4976	4249	10	262	3441	2717
Intragruppo y off-shore***	0	0	1784	1491	0	0	1313	1671	0	0	1050	1020
Otros	95	23	1233	2254	138	22	1236	1605	262	10	789	1542
Total	118	118	8174	8174	160	160	7525	7525	272	272	5279	5279

* 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 Nota: Los reportes publicados entre el 5 y el 15 de febrero de 2018 fueron corregidos respecto a la primera publicación debido a errores del sistema.

³ 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.