

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2018

Fecha de Información: 06 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\$2090.3 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	232.2	420.7	300.0	119.0	26.7	19.2	94.0
15-35	672.7	448.6	138.9	393.5	153.7	123.2	156.0
36-60	130.9	122.7	27.7	10.0	95.0	120.9	0.0
61-90	11.3	8.1	0.0	0.0	6.7	9.9	1.4
91-180	156.1	26.5	0.0	33.0	26.5	123.1	0.0
>180	75.0	52.1	0.0	10.0	37.1	50.0	15.0
Total	1278.1	1078.6	466.6	565.5	345.6	446.2	266.4

* 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	2.0 %	2.2 %	1.3 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
61-90	2.6 %	2.7 %	2.2 %	2.4 %
91-180	-	2.9 %	2.4 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.0 %	2.2 %	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	5264	4676	22	141	5079	4372	10	262	3447	2745
Intragruppo y off-shore***	0	0	2014	1579	0	0	1335	1682	0	0	1050	1021
Otros	95	23	1240	2263	141	22	1253	1613	262	10	817	1547
Total	119	119	8518	8518	163	163	7667	7667	272	272	5313	5313

* 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.