

Fecha de Publicación: 9 de febrero de 2018

Fecha de Información: 07 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\$1984.1 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	343.3	165.1	86.0	255.4	21.1	29.9	58.0
15-35	432.5	763.5	396.3	168.5	115.3	12.0	252.0
36-60	238.6	180.8	20.0	50.0	135.8	163.6	25.0
61-90	5.2	44.7	0.0	0.0	44.7	5.2	0.0
91-180	55.3	76.4	55.0	0.0	11.4	45.3	10.0
>180	14.6	9.0	0.0	10.0	9.0	4.6	0.0
Total	1089.6	1239.5	557.3	483.9	337.3	260.7	345.0

* 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	1.7 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	2.3 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.6 %	2.1 %	2.6 %
91-180	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
>180	-	2.9 %	2.4 %	2.6 %
Total	1.9 %	2.1 %	2.0 %	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	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	5447	4687	23	141	5160	4497	10	262	3483	2810
Intragruppo y off-shore***	0	0	2024	1758	0	0	1411	1712	0	0	1085	1021
Otros	95	23	1241	2268	141	23	1268	1631	262	10	822	1559
Total	119	119	8712	8712	164	164	7839	7839	273	273	5390	5390

* 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.