

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2018

Fecha de Información: 09 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\$1555.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	234.7	76.9	8.5	83.0	4.4	87.6	64.0
15-35	561.2	752.1	383.2	134.8	149.9	207.4	219.0
36-60	50.6	40.1	0.0	0.0	40.1	50.6	0.0
61-90	22.2	41.0	0.0	0.0	29.0	10.2	12.0
91-180	3.2	14.5	1.2	0.0	13.3	3.2	0.0
>180	13.9	40.4	10.0	0.0	30.4	13.9	0.0
Total	885.7	964.9	402.9	217.8	267.0	372.9	295.1

* 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	2.6 %	2.9 %	1.1 %	1.7 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.4 %	2.6 %
36-60	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	2.5 %	2.8 %	2.0 %	2.6 %
91-180	-	3.0 %	2.1 %	2.8 %
>180	-	2.7 %	2.1 %	2.6 %
Total	2.6 %	2.8 %	2.0 %	2.5 %

*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	97	5467	4700	32	145	5367	4650	16	265	3653	2937
Intragruppo y off-shore***	0	0	2027	1768	3	0	1434	1747	0	0	1101	1034
Otros	97	23	1241	2268	142	32	1314	1717	265	16	848	1631
Total	120	120	8736	8736	177	177	8114	8114	281	281	5602	5602

* 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.