

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2018

Fecha de Información: 12 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\$1944.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.³

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	338.6	261.7	171.8	135.5	28.8	142.0	61.1
15-35	515.1	433.6	115.3	228.0	235.2	204.0	83.1
36-60	273.7	154.4	0.0	35.5	144.4	228.2	10.0
61-90	4.1	4.6	0.0	0.0	4.6	4.1	0.0
91-180	36.5	35.4	0.0	0.0	20.4	21.5	15.0
>180	24.0	41.7	10.0	0.0	21.7	14.0	10.0
Total	1192.0	931.4	297.1	399.0	455.2	613.8	179.2

* 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	4.0 %	2.6 %	2.4 %	2.7 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
36-60	2.6 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	3.3 %	2.5 %	2.9 %
91-180	2.6 %	2.9 %	2.4 %	2.6 %
>180	2.6 %	2.9 %	2.3 %	2.7 %
Total	3.1 %	2.6 %	2.4 %	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	12 al 16 de febrero				19 al 23 de febrero				26 de feb. al 2 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	145	5622	4795	16	266	3655	2960	4	126	5259	4733
Intragrupa y off-shore***	3	0	1515	1804	0	0	1101	1037	0	0	2005	1934
Otros	143	33	1316	1854	266	16	871	1631	126	4	1013	1610
Total	179	179	8453	8453	282	282	5628	5628	130	130	8276	8276

* 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 intragrupo.