

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2018

Fecha de Información: 13 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\$1755.9 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	253.0	239.1	152.0	88.5	4.1	81.5	83.0
15-35	538.5	365.7	164.4	285.0	76.3	128.5	125.0
36-60	228.5	140.3	0.0	0.0	140.3	228.5	0.0
61-90	20.7	1.6	0.0	20.0	1.6	0.7	0.0
91-180	11.2	9.3	0.0	0.0	9.3	11.2	0.0
>180	39.2	141.6	55.0	0.0	61.6	14.2	25.0
Total	1091.2	897.7	371.4	393.5	293.3	464.7	233.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.5 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	3.3 %	2.7 %	2.7 %
91-180	-	2.9 %	2.5 %	2.7 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %
Total	2.6 %	2.6 %	2.5 %	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	146	5779	4964	16	266	3701	2992	5	126	5291	4757
Intragrupa y off-shore***	3	0	1604	1825	0	0	1127	1062	0	0	2005	1939
Otros	143	33	1318	1912	266	16	873	1647	126	5	1022	1622
Total	179	179	8701	8701	282	282	5701	5701	131	131	8318	8318

* 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.