

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2018

Fecha de Información: 14 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\$1962.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	328.6	304.9	192.4	218.3	20.3	18.2	92.2
15-35	571.1	541.1	264.0	169.8	113.9	238.2	163.1
36-60	174.2	111.1	0.0	6.5	101.1	157.7	10.0
61-90	39.4	18.5	0.0	0.0	8.5	29.4	10.0
91-180	8.4	61.1	2.0	0.0	54.6	3.9	4.5
>180	46.7	51.7	0.0	5.0	36.7	26.7	15.0
Total	1168.5	1088.4	458.4	399.6	335.1	474.1	294.8

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

*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	5889	5056	17	266	3773	3104	5	129	5336	4811
Intragrupa y off-shore***	3	0	1673	1904	0	0	1181	1076	0	0	2016	1943
Otros	143	33	1319	1920	266	17	877	1651	129	5	1040	1638
Total	179	179	8880	8880	283	283	5830	5830	133	133	8392	8392

* 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.