

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2018

Fecha de Información: 15 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\$2034.7 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	269.2	122.9	64.5	175.5	24.0	59.3	34.4
15-35	800.2	486.6	185.5	336.8	113.7	276.0	187.4
36-60	145.9	96.9	0.0	0.0	96.9	145.9	0.0
61-90	29.2	64.2	23.0	10.0	27.2	5.2	14.0
91-180	1.5	79.1	10.0	0.0	69.1	1.5	0.0
>180	113.0	61.8	35.0	40.0	26.8	73.0	0.0
Total	1359.0	911.5	318.0	562.3	357.7	560.9	235.8

* 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	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.3 %
15-35	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
36-60	-	2.7 %	2.5 %	2.6 %
61-90	2.4 %	2.7 %	2.4 %	2.6 %
91-180	-	2.9 %	2.2 %	2.9 %
>180	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.5 %	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	146	5935	5091	17	267	3821	3130	5	129	5398	4839
Intragrupa y off-shore***	3	0	1692	1935	0	0	1193	1076	0	0	2016	1973
Otros	143	33	1319	1920	267	17	886	1694	129	5	1054	1656
Total	179	179	8945	8945	284	284	5899	5899	134	134	8468	8468

* 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.