

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2018

Fecha de Información: 16 de febrero de 2018 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1628.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	547.8	475.2	91.0	149.0	37.1	51.8	347.0
15-35	557.9	387.7	155.8	241.8	23.6	107.8	208.4
36-60	0.8	26.9	0.0	0.0	26.9	0.8	0.0
61-90	44.7	23.5	15.1	15.3	8.4	29.4	0.0
91-180	0.7	28.6	0.1	0.0	28.6	0.7	0.0
>180	51.3	88.8	0.0	0.0	38.8	1.3	50.0
Total	1203.3	1030.6	261.9	406.1	163.3	191.8	605.4

* 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	2.1 %	1.6 %	1.8 %	1.9 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.8 %	2.0 %	2.8 %
61-90	-	2.9 %	2.4 %	2.5 %
91-180	-	2.8 %	2.4 %	2.8 %
>180	2.4 %	2.8 %	2.4 %	2.6 %
Total	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %

*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	5935	5093	15	288	4050	3311	6	127	5541	4940
Intragruppo y off-shore***	3	0	1692	1935	0	0	1277	1199	0	0	2023	1999
Otros	142	33	1320	1920	288	15	892	1709	127	6	1065	1691
Total	178	178	8947	8947	303	303	6219	6219	133	133	8629	8629

* 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 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.