

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2018

Fecha de Información: 20 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\$2267.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	510.7	451.5	58.5	76.4	13.0	54.3	380.0
15-35	1043.6	794.9	106.4	248.0	98.5	205.6	590.0
36-60	28.0	3.0	0.0	0.0	3.0	28.0	0.0
61-90	88.5	158.0	45.0	0.0	33.0	8.5	80.0
91-180	123.9	127.6	60.0	0.0	21.6	77.9	46.0
>180	11.5	31.8	20.0	0.0	1.8	1.5	10.0
Total	1806.2	1566.8	289.9	324.4	170.9	375.8	1106.0

* 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	1.8 %	3.2 %	1.4 %	1.9 %
15-35	1.7 %	2.1 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	3.9 %	2.0 %	2.2 %
61-90	2.0 %	2.3 %	1.6 %	2.1 %
91-180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.3 %	2.3 %	2.3 %	2.3 %
Total	-	2.4 %	1.8 %	1.9 %

* 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	19 al 23 de febrero				26 de feb. al 2 de marzo				5 al 9 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	288	4312	3557	6	125	5795	5171	7	105	3670	3959
Intragrupo y off-shore***	0	0	1358	1289	0	0	2043	2033	0	0	1605	1180
Otros	288	14	912	1737	125	6	1076	1710	105	7	1312	1447
Total	303	303	6582	6582	131	131	8914	8914	112	112	6586	6586

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.