

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2018

Fecha de Información: 21 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\$1872.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	381.2	315.0	155.0	172.0	3.5	52.7	156.5
15-35	715.4	525.8	218.8	329.5	190.1	269.0	117.0
36-60	19.0	44.7	30.0	0.0	4.7	9.0	10.0
61-90	17.1	6.4	0.0	10.0	6.4	7.1	0.0
91-180	1.5	12.9	0.0	0.0	12.9	1.5	0.0
>180	46.4	105.6	49.0	11.0	21.6	0.4	35.0
Total	1180.6	1010.3	452.8	522.5	239.1	339.7	318.5

* 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	1.3 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.7 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	2.3 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	2.4 %	1.8 %	2.3 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
Total	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %

*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	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	293	4484	3734	8	124	5965	5288	7	105	3795	3965
Intragrupo y off-shore***	0	0	1503	1411	0	0	2053	2081	0	0	1605	1265
Otros	293	14	896	1738	124	8	1080	1729	105	7	1313	1482
Total	307	307	6883	6883	131	131	9098	9098	112	112	6712	6712

* 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.