

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2018

Fecha de Información: 22 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\$1906.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	334.9	342.3	110.5	168.5	185.8	120.4	46.0
15-35	485.9	373.9	193.0	187.5	73.3	190.8	107.6
36-60	140.4	123.1	0.0	0.0	123.1	140.4	0.0
61-90	7.9	30.6	23.0	0.0	7.6	7.9	0.0
91-180	58.5	81.0	50.0	0.0	31.0	58.5	0.0
>180	54.1	76.6	20.0	0.0	7.6	5.1	49.0
Total	1081.7	1027.5	396.5	356.0	428.4	523.2	202.6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.7 %	1.3 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.0 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.1 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	2.1 %	2.0 %
>180	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
Total	1.2 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %

*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**	10	294	4553	3749	8	125	6220	5529	9	105	3810	4053
Intragruppo y off-shore***	0	0	1511	1465	0	0	2154	2195	0	0	1606	1265
Otros	294	10	894	1744	125	8	1189	1839	105	9	1389	1487
Total	304	304	6958	6958	133	133	9563	9563	114	114	6805	6805

* 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 intragruppo.