

Fecha de Publicación: 1 de marzo de 2018

Fecha de Información: 27 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\$2438.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	227.6	306.3	197.7	134.5	25.6	10.1	83.0
15-35	694.4	697.4	342.5	343.5	174.9	171.0	180.0
36-60	176.5	116.0	3.0	0.0	113.0	176.5	0.0
61-90	1.9	6.3	0.0	0.0	6.3	1.9	0.0
91-180	248.7	63.9	32.8	235.0	21.0	3.7	10.0
>180	104.0	160.5	50.0	10.0	18.5	2.0	92.0
Total	1453.2	1350.3	626.0	723.0	359.3	365.3	365.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %
15-35	1.0 %	1.1 %	0.8 %	1.0 %
36-60	-	1.1 %	1.0 %	1.0 %
61-90	-	1.9 %	1.3 %	1.7 %
91-180	1.8 %	2.6 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.3 %	2.1 %	2.2 %	2.2 %
Total	1.3 %	1.2 %	1.0 %	1.2 %

*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	26 de feb. al 2 de marzo				5 al 9 de marzo				12 al 16 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	117	6719	6098	15	106	4059	4141	23	114	4496	3547
Intragruppo y off-shore***	0	0	2596	2534	0	0	1617	1387	0	0	1376	1660
Otros	117	9	1197	1879	106	15	1418	1565	114	23	1136	1801
Total	126	126	10512	10512	121	121	7093	7093	136	136	7008	7008

* 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.