

Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2018

Fecha de Información: 28 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\$2129.9 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	408.5	305.8	109.0	202.0	23.8	33.5	173.0
15-35	476.0	678.8	369.5	187.5	86.2	65.3	223.1
36-60	157.5	154.9	2.5	0.0	107.4	112.5	45.0
61-90	5.9	11.5	0.0	0.0	11.5	5.9	0.0
91-180	48.4	41.9	0.0	34.5	31.9	3.9	10.0
>180	240.1	131.9	40.0	160.0	11.9	0.1	80.0
Total	1336.3	1324.7	521.0	584.0	272.6	221.2	531.1

* 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	1.0 %	1.4 %	3.0 %	1.8 %
15-35	1.2 %	1.5 %	1.1 %	1.3 %
36-60	1.4 %	1.2 %	1.0 %	1.2 %
61-90	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
91-180	1.7 %	2.3 %	1.7 %	2.0 %
>180	2.3 %	2.1 %	2.2 %	2.2 %
Total	1.3 %	1.5 %	1.8 %	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	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	116	6906	6162	16	107	4142	4261	23	115	4666	3678
Intragrupo y off-shore***	0	0	2624	2679	0	0	1683	1401	0	0	1391	1703
Otros	116	9	1208	1898	107	16	1429	1592	115	23	1142	1818
Total	125	125	10738	10738	123	123	7253	7253	138	138	7199	7199

* 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.