Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2018

Fecha de Información: 19 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$627.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.[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	428.6	442.9	42.7	48.0	22.1	2.6	378.0
15-35	44.8	51.9	27.0	6.7	4.9	18.1	20.0
36-60	0.4	1.1	0.0	0.0	1.1	0.4	0.0
61-90	0.1	5.5	0.0	0.0	5.5	0.1	0.0
91-180	41.0	8.9	0.0	0.0	8.9	41.0	0.0
>180	0.0	0.2	0.0	0.0	0.2	0.0	0.0
Total	**514.9**	**510.6**	**69.7**	**54.7**	**42.9**	**62.2**	**398.0**

* 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	2.0 %	1.9 %	2.8 %	2.1 %
15-35	2.0 %	2.6 %	1.7 %	2.2 %
36-60	-	2.6 %	2.0 %	2.4 %
61-90	-	2.6 %	-0.9 %	2.5 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.3 %
>180	-	3.1 %	-	3.1 %
Total	-	2.2 %	2.4 %	2.1 %

*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	290	4188	3460	6	125	5643	5042	7	104	3525	3825
Intragrupo y off-shore***	0	0	1300	1224	0	0	2043	2022	0	0	1601	1175
Otros	290	14	906	1710	125	6	1069	1692	104	7	1312	1438
Total	**305**	**305**	**6394**	**6394**	**131**	**131**	**8755**	**8755**	**111**	**111**	**6437**	**6437**

* 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 intragrupo.