

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2018

Fecha de Información: 01 de marzo de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1974.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	212.2	278.1	214.3	118.3	13.9	44.0	50.0
15-35	659.9	717.9	231.3	164.8	127.6	136.1	359.0
36-60	175.4	64.6	0.0	0.0	64.6	175.4	0.0
61-90	77.2	89.5	0.0	10.0	34.5	12.2	55.0
91-180	44.4	32.1	0.0	20.8	22.1	13.6	10.0
>180	85.6	91.8	0.0	0.0	11.8	5.6	80.0
Total	1254.7	1274.1	445.6	313.8	274.5	386.9	554.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.4 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	1.2 %	1.2 %	1.2 %
61-90	1.6 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.8 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.4 %	2.3 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.5 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %

*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**	8	116	6968	6249	24	109	4222	4322	23	116	4728	3819
Intragruo y off-shore***	0	0	2712	2739	0	0	1717	1446	0	0	1498	1716
Otros	116	8	1208	1899	109	24	1436	1607	116	23	1146	1837
Total	125	125	10888	10888	133	133	7375	7375	139	139	7372	7372

* 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 intragruo.