

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2018

Fecha de Información: 02 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\$1780.5 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	183.1	256.9	183.0	92.0	13.5	30.7	60.4
15-35	484.4	662.3	354.5	191.3	73.8	59.1	234.0
36-60	105.4	45.7	0.0	0.0	45.7	105.4	0.0
61-90	175.5	83.9	20.0	120.0	8.9	0.5	55.0
91-180	70.8	29.0	3.0	70.0	26.0	0.8	0.0
>180	15.4	32.6	10.0	0.0	7.6	0.4	15.0
Total	1034.5	1110.3	570.5	473.3	175.4	196.9	364.4

* 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	
3-14	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	2.5 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.3 %	1.7 %	2.2 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.4 %	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**	8	114	6968	6251	29	109	4373	4501	23	115	4757	3901
Intragrupo y off-shore***	0	0	2712	2739	0	0	1832	1533	0	0	1566	1721
Otros	114	8	1209	1899	109	29	1450	1621	115	23	1150	1851
Total	122	122	10890	10890	139	139	7654	7654	137	137	7473	7473

* 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.