

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2018

Fecha de Información: 02 de marzo 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\$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 | 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.