

Fecha de Publicación: 8 de marzo de 2018

Fecha de Información: 06 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\$1941.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	344.9	219.0	62.0	191.9	11.5	7.5	145.5
15-35	612.3	552.6	145.0	286.5	184.6	102.8	223.0
36-60	198.0	219.4	0.0	0.0	189.4	168.0	30.0
61-90	1.7	35.6	0.0	0.0	35.6	1.7	0.0
91-180	12.5	31.3	0.0	0.0	21.3	2.5	10.0
>180	76.1	111.5	28.0	10.0	18.2	0.8	65.3
Total	1245.6	1169.4	235.0	488.4	460.6	283.4	473.8

* 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	0.9 %	1.4 %	0.8 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.6 %	0.9 %	1.1 %
36-60	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.9 %	0.9 %	1.8 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.6 %	2.1 %
>180	2.3 %	2.3 %	2.2 %	2.3 %
Total	1.1 %	1.6 %	1.0 %	1.2 %

*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	5 al 9 de marzo				12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	112	4749	4755	21	115	5016	4743	17	115	3204	2823
Intragrupo y off-shore***	0	0	2008	1840	0	0	1662	1791	0	0	884	1052
Otros	112	32	1465	1627	115	21	1714	1858	115	17	1114	1327
Total	144	144	8222	8222	137	137	8392	8392	132	132	5202	5202

* 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.