

Fecha de Publicación: 9 de marzo de 2018

Fecha de Información: 07 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\$2045.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	471.9	284.6	89.0	284.5	16.6	8.4	179.0
15-35	667.8	749.9	324.9	215.3	137.0	164.4	288.0
36-60	96.9	51.6	0.0	0.0	51.6	96.9	0.0
61-90	50.7	43.9	30.0	40.0	3.9	0.7	10.0
91-180	14.0	33.3	14.0	0.0	9.3	4.0	10.0
>180	55.0	53.0	10.0	15.0	3.0	0.0	40.0
Total	1356.3	1216.2	467.9	554.8	221.3	274.4	527.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.6 %	0.8 %	0.6 %	0.7 %
15-35	0.5 %	0.6 %	0.7 %	0.6 %
36-60	-	0.6 %	0.7 %	0.7 %
61-90	0.9 %	1.0 %	0.9 %	0.9 %
91-180	1.3 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
>180	2.2 %	2.1 %	1.8 %	2.1 %
Total	0.7 %	0.8 %	0.7 %	0.7 %

*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**	35	111	5043	4847	22	121	5150	4923	17	116	3283	2888
Intragruppo y off-shore***	0	0	2038	2077	0	0	1720	1808	0	0	908	1082
Otros	111	35	1470	1627	121	22	1724	1863	116	17	1115	1336
Total	145	145	8551	8551	143	143	8594	8594	133	133	5306	5306

* 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 intragruppo.