

Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2018

Fecha de Información: 15 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\$1941.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.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	420.8	372.9	127.0	175.2	42.4	42.0	203.5
15-35	650.8	670.9	292.5	272.0	157.4	157.8	221.0
36-60	16.8	2.6	0.0	0.7	2.6	16.1	0.0
61-90	81.0	35.0	0.0	55.0	15.0	6.0	20.0
91-180	50.5	13.2	0.0	50.0	13.2	0.5	0.0
>180	68.2	12.8	0.2	10.0	2.6	48.2	10.0
Total	1288.1	1107.5	419.7	562.9	233.3	270.6	454.5

* 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	0.8 %	0.8 %	0.5 %	0.7 %
15-35	0.7 %	0.8 %	0.7 %	0.7 %
36-60	-	1.7 %	0.7 %	0.8 %
61-90	1.1 %	2.2 %	1.0 %	1.5 %
91-180	-	2.1 %	1.5 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.5 %	1.7 %	1.8 %
Total	0.8 %	0.9 %	0.7 %	0.8 %

* 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	12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo				26 al 30 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	135	6294	6257	23	122	3890	3469	13	126	3088	2861
Intragruppo y off-shore***	0	0	2536	2313	0	0	1023	1181	0	0	1256	1550
Otros	135	18	1850	2110	122	23	1198	1462	126	13	551	484
Total	153	153	10680	10680	145	145	6112	6112	139	139	4895	4895

* 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.