

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2018

Fecha de Información: 20 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\$2625.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	523.3	573.0	348.5	295.5	13.5	16.8	211.0
15-35	654.9	757.3	276.2	189.5	353.1	337.5	128.0
36-60	236.2	68.5	1.0	0.0	62.5	231.2	5.0
61-90	6.2	7.9	0.0	0.0	7.9	6.2	0.0
91-180	5.2	26.4	4.2	0.0	17.3	0.2	5.0
>180	92.9	95.0	15.0	20.0	8.0	0.9	72.0
Total	1518.7	1528.2	644.8	504.9	462.3	592.8	421.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	1.2 %	0.8 %	1.0 %
15-35	1.3 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.3 %	1.1 %	1.0 %	1.0 %
61-90	-	2.5 %	1.2 %	1.9 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.5 %	1.9 %
>180	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
Total	1.3 %	1.2 %	0.9 %	1.1 %

*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	19 al 23 de marzo				26 al 30 de marzo				2 al 6 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	124	4375	4000	13	134	3147	3006	11	112	3806	3737
Intragrupo y off-shore***	0	0	1378	1496	0	0	1353	1562	0	0	1205	1175
Otros	124	17	1209	1466	134	13	557	489	112	11	1239	1338
Total	140	140	6962	6962	147	147	5057	5057	122	122	6250	6250

* 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.