

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2018

Fecha de Información: 22 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\$2185.2 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	243.3	348.1	196.0	67.5	13.0	36.7	139.1
15-35	484.1	651.4	404.0	191.0	91.3	137.0	156.1
36-60	241.5	169.2	0.0	0.0	169.2	241.5	0.0
61-90	19.6	20.6	0.0	0.0	9.9	8.8	10.7
91-180	137.4	61.7	0.0	120.0	51.7	7.4	10.0
>180	120.4	33.9	0.0	90.0	3.9	0.4	30.0
Total	1246.2	1284.9	600.0	468.5	339.0	431.8	345.9

* 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	1.5 %	2.7 %	1.2 %	1.9 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.1 %	1.1 %	1.1 %
61-90	1.5 %	1.9 %	1.0 %	1.5 %
91-180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.5 %	1.7 %	1.3 %	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	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**	16	123	4682	4308	16	129	3204	3200	15	112	4013	3944
Intragrupo y off-shore***	0	0	1507	1587	0	0	1496	1563	0	0	1284	1212
Otros	123	16	1210	1504	128	16	564	501	112	15	1259	1400
Total	140	140	7399	7399	145	145	5264	5264	127	127	6556	6556

* 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.