

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1107.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	118.5	183.0	93.0	32.1	9.0	5.5	81.0
15-35	485.6	406.3	189.3	151.0	73.1	190.6	144.0
36-60	7.0	28.7	0.0	0.0	28.7	7.0	0.0
61-90	25.9	6.5	0.0	24.0	6.5	1.9	0.0
91-180	6.2	30.1	7.0	4.0	23.1	2.3	0.0
>180	22.6	12.4	0.0	22.0	12.4	0.6	0.0
Total	665.8	667.0	289.3	233.0	152.8	207.8	225.0

* 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	1.5 %	1.5 %	0.7 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	2.2 %	1.6 %	2.1 %
>180	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %

*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	4683	4309	14	138	3234	3247	17	112	4099	4071
Intragrupo y off-shore***	0	0	1507	1587	0	0	1548	1592	0	0	1325	1215
Otros	123	16	1211	1504	137	14	559	502	112	17	1265	1403
Total	139	139	7400	7400	152	152	5341	5341	129	129	6689	6689

* 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.