

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1438.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	65.1	91.7	64.6	47.0	21.1	12.1	6.0
15-35	627.9	409.8	87.0	321.7	166.6	149.9	156.3
36-60	31.2	71.3	0.0	2.1	71.3	29.1	0.0
61-90	15.2	29.9	3.0	11.9	26.9	3.3	0.0
91-180	30.5	103.8	3.9	20.0	89.9	0.5	10.0
>180	63.1	73.9	0.9	60.0	70.0	0.1	3.0
Total	833.1	780.5	159.4	462.7	445.8	195.1	175.3

* 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	1.4 %	1.7 %	1.0 %	1.4 %
15-35	1.1 %	1.6 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	1.8 %	1.0 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.5 %	2.0 %
91-180	1.7 %	2.2 %	1.6 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.2 %	1.9 %	1.2 %	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	26 al 30 de marzo				2 al 6 de abril				9 al 13 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	138	3245	3301	18	117	4163	4078	10	138	3162	2980
Intragruppo y off-shore***	0	0	1594	1592	0	0	1325	1262	0	0	890	924
Otros	138	14	567	513	117	18	1271	1418	138	10	1099	1248
Total	153	153	5405	5405	136	136	6758	6758	147	147	5151	5151

* 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.