

Fecha de Publicación: 2 de abril de 2018

Fecha de Información: 27 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\$1609.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	163.3	130.4	57.0	98.0	23.4	15.3	50.0
15-35	688.7	458.2	56.9	373.5	264.2	178.2	137.0
36-60	35.4	65.5	0.0	0.0	35.5	5.4	30.0
61-90	23.7	57.2	1.5	13.0	45.7	0.7	10.0
91-180	5.6	86.4	6.0	0.0	75.4	0.6	5.0
>180	43.0	105.5	0.2	20.0	84.3	2.0	21.0
Total	959.7	903.2	121.7	504.5	528.5	202.2	253.0

* 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 %	0.8 %	0.8 %	0.8 %
15-35	0.9 %	1.3 %	0.8 %	1.0 %
36-60	0.9 %	1.7 %	1.0 %	1.3 %
61-90	1.2 %	2.0 %	1.1 %	1.9 %
91-180	1.6 %	2.2 %	1.6 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	1.1 %	1.5 %	0.8 %	1.2 %

*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	139	3275	3361	23	119	4256	4126	14	142	3254	3028
Intragrupo y off-shore***	0	0	1639	1607	0	0	1337	1320	0	0	890	949
Otros	138	14	572	517	119	23	1275	1422	142	14	1121	1289
Total	153	153	5485	5485	141	141	6868	6868	156	156	5265	5265

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.