

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2018

Fecha de Información: 28 de marzo de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1290.1 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 | 108.5 | 191.4 | 88.0 | 30.0 | 48.4 | 23.5 | 55.0 |
| 15-35 | 556.5 | 365.2 | 143.0 | 366.0 | 86.7 | 55.0 | 135.5 |
| 36-60 | 5.3 | 24.5 | 1.7 | 0.0 | 22.8 | 5.3 | 0.0 |
| 61-90 | 36.7 | 50.4 | 1.6 | 35.0 | 48.8 | 1.7 | 0.0 |
| 91-180 | 27.6 | 112.5 | 2.0 | 0.0 | 85.5 | 2.6 | 25.0 |
| >180 | 0.7 | 26.4 | 0.0 | 0.0 | 26.4 | 0.7 | 0.0 |
| Total | 735.3 | 770.3 | 236.3 | 431.0 | 318.5 | 88.8 | 215.5 |

* 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 | |
| 3-14 | 0.8 % | 1.1 % | 0.5 % | 1.0 % |
| 15-35 | 0.8 % | 1.4 % | 0.7 % | 0.9 % |
| 36-60 | - | 1.6 % | 0.8 % | 1.4 % |
| 61-90 | - | 1.8 % | 1.2 % | 1.6 % |
| 91-180 | 1.5 % | 2.3 % | 1.7 % | 2.1 % |
| >180 | - | 2.3 % | 2.0 % | 2.3 % |
| Total | 0.9 % | 1.6 % | 0.8 % | 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 | 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 | 3305 | 3361 | 23 | 116 | 4340 | 4331 | 14 | 145 | 3322 | 3037 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1639 | 1637 | 0 | 0 | 1425 | 1345 | 0 | 0 | 890 | 994 |
| Otros | 137 | 14 | 572 | 518 | 116 | 23 | 1336 | 1426 | 145 | 14 | 1130 | 1312 |
| Total | 152 | 152 | 5516 | 5516 | 140 | 140 | 7102 | 7102 | 159 | 159 | 5342 | 5342 |

* 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.