

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2018

Fecha de Información: 28 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\$1290.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	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
Intragruppo 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.