Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2018

Fecha de Información: 05 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$1360.3 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	313.3	330.1	209.6	204.6	20.5	8.7	100.0
15-35	260.3	195.2	78.0	83.0	80.2	140.3	37.0
36-60	194.1	81.3	5.0	0.0	56.3	174.1	20.0
61-90	11.5	5.7	0.0	0.0	5.7	11.5	0.0
91-180	11.7	31.5	0.0	0.0	31.5	11.7	0.0
>180	62.3	70.2	10.0	0.0	10.2	12.3	50.0
Total	**853.3**	**714.0**	**302.6**	**287.6**	**204.4**	**358.7**	**207.0**

* 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	1.2 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.6 %
91-180	-	2.4 %	1.6 %	2.2 %
>180	2.4 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.5 %	1.5 %	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	5 al 9 de marzo				12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	114	4539	4658	21	116	4904	4069	17	114	3125	3143
Intragrupo y off-shore***	0	0	1976	1697	0	0	1632	1761	0	0	884	1032
Otros	114	32	1463	1623	116	21	1153	1857	114	17	1484	1318
Total	**146**	**146**	**7977**	**7977**	**137**	**137**	**7688**	**7688**	**131**	**131**	**5493**	**5493**

* 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.