Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2018

Fecha de Información: 09 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$1168.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.[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	129.9	252.6	168.5	50.5	38.1	33.4	46.0
15-35	433.2	281.4	61.8	175.3	153.1	191.4	66.5
36-60	1.0	10.8	2.0	0.0	8.8	1.0	0.0
61-90	1.4	5.5	0.0	0.0	5.5	1.4	0.0
91-180	71.5	24.0	1.2	0.0	12.8	61.5	10.0
>180	67.6	77.5	0.0	0.0	12.5	2.6	65.0
Total	**704.7**	**651.7**	**233.5**	**225.8**	**230.8**	**291.4**	**187.5**

* 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	Compras	Ventas	
3-14	0.5 %	0.7 %	0.4 %	0.5 %
15-35	0.5 %	0.6 %	0.4 %	0.5 %
36-60	-	1.4 %	0.4 %	1.3 %
61-90	-	3.7 %	1.1 %	3.1 %
91-180	1.5 %	2.2 %	1.1 %	1.3 %
>180	2.0 %	2.4 %	1.7 %	2.0 %
Total	1.1 %	0.8 %	0.5 %	0.7 %

*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**	35	111	5264	4879	18	127	5569	5451	22	118	3414	3044
Intragrupo y off-shore***	0	0	2049	2286	0	0	2020	1960	0	0	968	1096
Otros	111	35	1475	1623	127	18	1848	2025	118	22	1121	1362
Total	**146**	**146**	**8788**	**8788**	**145**	**145**	**9437**	**9437**	**139**	**139**	**5503**	**5503**

* 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.