Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2018

Fecha de Información: 14 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$1715.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.[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	410.1	446.0	143.0	136.0	52.0	23.1	251.0
15-35	433.2	276.7	101.3	227.8	62.4	92.4	113.0
36-60	87.1	75.4	3.4	0.0	61.9	77.1	10.1
61-90	24.8	13.8	0.0	0.0	13.8	24.8	0.0
91-180	15.4	78.2	35.1	0.0	38.2	10.4	5.0
>180	214.9	116.4	0.0	58.0	19.4	59.9	97.0
Total	**1185.5**	**1006.5**	**282.7**	**421.8**	**247.7**	**287.6**	**476.1**

* 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 %	0.7 %	0.6 %
15-35	0.6 %	0.8 %	0.5 %	0.6 %
36-60	1.1 %	1.0 %	0.9 %	1.0 %
61-90	1.8 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.4 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
>180	2.1 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %
Total	0.9 %	1.0 %	0.9 %	0.9 %

*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	12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo				26 al 30 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	135	6157	6080	23	119	3739	3368	12	101	2956	2794
Intragrupo y off-shore***	0	0	2457	2271	0	0	982	1121	0	0	1249	1476
Otros	135	18	1846	2109	119	23	1191	1423	101	12	548	482
Total	**152**	**152**	**10461**	**10461**	**142**	**142**	**5912**	**5912**	**113**	**113**	**4753**	**4753**

* 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.