Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2018

Fecha de Información: 16 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$967.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.[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	71.4	153.5	103.2	31.8	15.3	4.6	35.0
15-35	356.6	359.6	223.0	214.7	11.7	16.8	125.0
36-60	19.0	3.8	0.0	17.5	3.8	1.5	0.0
61-90	54.1	30.8	0.0	20.0	15.8	19.1	15.0
91-180	30.3	48.2	30.0	0.0	18.2	30.3	0.0
>180	10.1	4.9	0.0	10.0	4.9	0.1	0.0
Total	**541.4**	**600.8**	**356.2**	**294.0**	**69.7**	**72.4**	**175.0**

* 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	1.0 %	1.0 %	0.5 %	0.9 %
15-35	0.9 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %
36-60	-	1.4 %	0.3 %	1.1 %
61-90	1.1 %	1.6 %	1.1 %	1.3 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.5 %
>180	-	2.4 %	2.1 %	2.2 %
Total	1.0 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

[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.

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	133	6294	6257	23	117	3925	3583	14	134	3123	2894
Intragrupo y off-shore***	0	0	2536	2313	0	0	1117	1201	0	0	1265	1562
Otros	133	18	1851	2110	117	23	1206	1463	134	14	552	485
Total	**151**	**151**	**10681**	**10681**	**140**	**140**	**6247**	**6247**	**148**	**148**	**4940**	**4940**

* 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.