

Fecha de Publicación: 4 de abril de 2018

Fecha de Información: 02 de abril 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\$1032.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.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	205.6	218.3	38.0	34.5	27.3	18.1	153.0
15-35	361.1	408.5	106.5	70.1	169.5	158.5	132.5
36-60	1.8	4.7	0.0	0.0	4.7	1.8	0.0
61-90	45.8	7.6	0.0	40.0	7.6	5.8	0.0
91-180	4.0	14.9	0.1	0.0	14.8	4.0	0.0
>180	40.0	35.3	1.2	10.0	4.2	0.0	30.0
Total	658.3	689.4	145.7	154.6	228.2	188.2	315.5

* 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	0.6 %	0.6 %	0.5 %	0.6 %
15-35	0.5 %	0.7 %	0.5 %	0.6 %
36-60	-	1.5 %	0.6 %	1.3 %
61-90	-	2.0 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	2.2 %	1.4 %	2.0 %
>180	2.1 %	2.9 %	-	2.2 %
Total	0.7 %	0.8 %	0.7 %	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	2 al 6 de abril				9 al 13 de abril				16 al 20 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	118	4472	4461	15	145	3394	3111	26	118	3633	3094
Intragruppo y off-shore***	0	0	1463	1380	0	0	890	994	0	0	1068	1215
Otros	118	25	1334	1429	145	15	1146	1326	118	26	1192	1584
Total	143	143	7270	7270	160	160	5430	5430	144	144	5892	5892

* 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.