

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2018

Fecha de Información: 05 de abril de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1804.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	196.3	196.7	105.5	105.0	41.2	41.3	50.0
15-35	437.4	569.2	288.8	15.0	177.5	319.4	103.0
36-60	153.3	157.1	0.0	0.0	157.1	153.3	0.0
61-90	97.2	44.3	5.0	26.3	14.2	45.9	25.0
91-180	50.3	49.7	18.6	30.0	11.0	0.3	20.0
>180	45.0	11.2	0.0	40.0	6.2	0.0	5.0
Total	979.5	1028.1	417.9	216.3	407.2	560.2	203.0

* 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	
3-14	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.3 %	0.9 %	1.1 %
36-60	-	0.9 %	0.8 %	0.9 %
61-90	1.6 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.7 %	2.3 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.4 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %

*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	131	4796	4893	17	148	3690	3454	26	119	3827	3275
Intragrupo y off-shore***	0	0	1717	1516	0	0	1077	1171	0	0	1107	1253
Otros	131	25	1323	1427	148	17	1230	1372	119	26	1212	1619
Total	155	155	7836	7836	165	165	5997	5997	146	146	6147	6147

* 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.