

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2018

Fecha de Información: 06 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\$901.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	75.5	154.1	108.0	28.0	28.1	29.5	18.0
15-35	218.2	372.3	236.0	102.0	70.3	50.2	66.0
36-60	2.0	46.1	0.0	0.0	46.1	2.0	0.0
61-90	21.0	8.2	0.0	10.0	3.2	6.0	5.0
91-180	10.7	22.2	0.0	0.0	12.2	0.7	10.0
>180	55.0	29.8	12.0	40.0	2.8	0.0	15.0
Total	382.4	632.7	356.0	180.0	162.7	88.4	114.0

* 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	1.5 %	1.7 %	-2.0 %	0.5 %
15-35	1.2 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.0 %	1.1 %	1.9 %
61-90	1.7 %	2.5 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
Total	1.4 %	1.7 %	0.7 %	1.4 %

*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	4892	21	146	3740	3550	26	120	3852	3333
Intragrupo y off-shore***	0	0	1717	1516	0	0	1139	1199	0	0	1153	1253
Otros	131	25	1322	1428	146	21	1250	1381	120	26	1220	1639
Total	156	156	7836	7836	167	167	6130	6130	146	146	6225	6225

* 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 intragrupo.