

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2018

Fecha de Información: 11 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\$2383.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	284.6	193.7	46.2	153.8	56.6	39.8	91.0
15-35	854.9	792.1	282.0	342.3	410.6	413.2	99.5
36-60	95.8	40.8	0.0	0.0	30.8	85.8	10.0
61-90	0.6	61.1	0.0	0.0	61.1	0.6	0.0
91-180	45.9	63.1	0.0	40.0	63.1	5.9	0.0
>180	95.0	66.8	0.0	60.0	56.8	25.0	10.0
Total	1376.7	1217.7	328.2	596.1	679.0	570.1	210.5

* 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	0.9 %	1.7 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
36-60	1.5 %	2.2 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.2 %	2.0 %
91-180	-	2.4 %	1.7 %	2.1 %
>180	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.2 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %

* 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	9 al 13 de abril				16 al 20 de abril				23 al 27 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	153	4571	4104	27	125	4043	3638	7	202	4136	3602
Intragruppo y off-shore***	0	0	1349	1659	0	0	1330	1382	0	0	1054	1386
Otros	153	21	1293	1451	125	27	1309	1662	202	7	1525	1727
Total	174	174	7214	7214	153	153	6682	6682	209	209	6715	6715

* 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 intragruppo.