

Fecha de Publicación: 16 de abril de 2018

Fecha de Información: 12 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\$1612.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	94.5	111.9	64.0	27.0	9.9	29.5	38.0
15-35	571.2	642.0	219.5	102.3	298.0	344.4	124.5
36-60	53.5	53.9	0.0	0.0	53.9	53.5	0.0
61-90	95.2	23.2	1.8	20.0	21.4	75.2	0.0
91-180	21.6	62.2	20.0	11.0	32.2	0.6	10.0
>180	22.4	33.5	12.0	22.0	21.5	0.4	0.0
Total	858.5	926.8	317.3	182.3	437.0	503.7	172.5

* 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	0.8 %	1.0 %	0.7 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.2 %	1.1 %	1.1 %
36-60	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.5 %	2.1 %	1.4 %	1.9 %
>180	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %
Total	0.9 %	1.3 %	1.2 %	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	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	145	4587	4108	28	128	4101	3722	7	202	4159	3620
Intragruppo y off-shore***	0	0	1352	1673	0	0	1392	1395	0	0	1054	1386
Otros	145	21	1292	1450	128	28	1308	1683	202	7	1531	1738
Total	166	166	7231	7231	156	156	6801	6801	209	209	6744	6744

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.