

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2018

Fecha de Información: 13 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\$2000.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	250.0	295.1	159.2	78.0	48.0	84.0	88.0
15-35	439.6	695.9	387.0	162.0	140.9	109.6	168.0
36-60	59.9	39.1	0.0	0.0	9.1	29.9	30.0
61-90	77.3	50.4	0.0	33.0	17.9	11.8	32.5
91-180	124.4	89.1	0.2	51.6	18.9	2.7	70.1
>180	244.4	54.4	0.0	205.0	24.2	9.2	30.2
Total	1195.6	1224.0	546.3	529.6	258.9	247.2	418.8

* 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	0.9 %	0.9 %	0.4 %	0.7 %
15-35	0.9 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %
36-60	1.1 %	1.7 %	0.5 %	0.9 %
61-90	1.2 %	1.7 %	1.0 %	1.3 %
91-180	1.5 %	2.2 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.1 %	1.1 %	1.0 %	1.0 %

* 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	31	128	4244	3905	8	203	4262	3730
Intragrupo y off-shore***	0	0	1352	1673	0	0	1516	1458	0	0	1089	1401
Otros	145	21	1292	1450	128	31	1318	1714	203	8	1568	1787
Total	166	166	7231	7231	159	159	7078	7078	211	211	6918	6918

* 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 intragrupo.