

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2018

Fecha de Información: 16 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\$1242.9 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	183.1	245.9	120.0	43.4	11.4	25.2	114.5
15-35	420.7	359.1	128.5	123.0	92.5	159.6	138.1
36-60	72.2	82.7	0.0	0.0	82.7	72.2	0.0
61-90	0.7	9.3	0.0	0.0	9.3	0.7	0.0
91-180	24.3	15.3	0.0	20.0	15.3	4.3	0.0
>180	70.3	61.7	0.0	20.0	11.7	0.3	50.0
Total	771.4	774.1	248.5	206.4	223.0	262.4	302.6

* 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	1.3 %	1.2 %	0.6 %	1.1 %
15-35	1.0 %	1.6 %	0.9 %	1.2 %
36-60	-	1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	2.7 %	1.2 %	2.6 %
91-180	-	2.1 %	1.4 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.3 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.3 %	1.5 %	0.9 %	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

Sector	16 al 20 de abril				23 al 27 de abril				30 de abr. al 4 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	131	4347	4020	8	204	4328	3838	11	105	2899	2810
Intragrupo y off-shore***	0	0	1567	1487	0	0	1158	1415	0	0	851	691
Otros	131	32	1315	1722	204	8	1572	1804	105	11	1030	1279
Total	163	163	7229	7229	212	212	7057	7057	116	116	4779	4779

* 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.