

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2018

Fecha de Información: 17 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\$2059.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	393.5	475.1	224.5	147.0	15.1	11.0	235.5
15-35	582.3	661.2	271.4	143.8	128.3	177.0	261.5
36-60	101.0	92.8	40.0	0.0	12.8	61.0	40.0
61-90	151.0	10.3	0.0	146.3	10.3	4.7	0.0
91-180	3.4	26.8	0.0	0.0	26.8	3.4	0.0
>180	61.0	57.8	0.0	40.0	37.8	1.0	20.0
Total	1292.2	1323.9	535.9	477.0	231.0	258.2	557.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.3 %	1.4 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.1 %	1.3 %
36-60	1.4 %	2.7 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	2.1 %	1.3 %	1.9 %
91-180	-	2.1 %	1.4 %	2.0 %
>180	1.8 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.3 %	1.5 %	1.2 %	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	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	4680	4401	8	205	4408	3947	11	105	2907	2829
Intragruppo y off-shore***	0	0	1755	1624	0	0	1215	1446	0	0	866	693
Otros	131	32	1315	1726	205	8	1580	1810	105	11	1034	1285
Total	163	163	7751	7751	214	214	7203	7203	115	115	4807	4807

* 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 intragruppo.