

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2018

Fecha de Información: 18 de abril de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1689.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	265.3	307.9	132.3	87.0	50.7	53.3	125.0
15-35	545.2	524.5	231.0	178.0	91.0	164.7	202.5
36-60	87.5	4.4	0.0	0.0	4.4	87.5	0.0
61-90	119.3	27.8	6.0	113.2	21.8	6.2	0.0
91-180	20.4	43.9	15.0	20.0	28.9	0.4	0.0
>180	50.6	30.0	0.0	35.0	20.0	5.6	10.0
Total	1088.4	938.5	384.3	433.2	216.8	317.7	337.5

* 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 intragrupo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.1 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	1.8 %	1.2 %	1.3 %
61-90	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
91-180	-	2.1 %	1.5 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %

*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	4823	4543	9	206	4465	4055	11	105	2975	2914
Intragrupo y off-shore***	0	0	1821	1690	0	0	1271	1463	0	0	898	697
Otros	131	32	1317	1728	206	9	1622	1840	105	11	1047	1309
Total	163	163	7961	7961	214	214	7358	7358	116	116	4920	4920

* 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 intragrupo.