

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2018

Fecha de Información: 23 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\$2179.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	366.4	256.9	207.0	240.7	0.9	76.6	49.0
15-35	493.6	653.1	426.4	135.0	56.7	188.6	170.0
36-60	195.7	164.4	63.6	60.0	90.8	125.7	10.0
61-90	8.9	4.5	0.0	0.0	4.5	8.9	0.0
91-180	81.2	29.9	0.0	50.0	19.9	21.2	10.0
>180	125.2	129.0	30.0	20.0	9.0	15.2	90.0
Total	1271.1	1237.7	727.0	505.7	181.7	436.3	329.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	1.3 %	0.6 %	0.9 %
15-35	1.1 %	1.3 %	0.7 %	1.0 %
36-60	1.2 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
61-90	-	2.2 %	1.0 %	1.4 %
91-180	1.2 %	1.9 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.2 %	1.3 %	0.8 %	1.1 %

*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	23 al 27 de abril				30 de abr. al 4 de mayo				7 al 11 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	208	5006	4442	15	104	3166	3195	8	113	3709	3658
Intragrupo y off-shore***	0	0	1579	1874	0	0	1045	709	0	0	1377	1086
Otros	208	36	1638	1908	104	15	1069	1376	113	8	1379	1720
Total	244	244	8224	8224	119	119	5279	5279	121	121	6464	6464

* 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.