

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2018

Fecha de Información: 24 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\$1698.7 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	193.5	186.9	128.3	116.7	18.6	36.8	40.0
15-35	550.2	369.8	218.5	215.8	87.3	270.5	64.0
36-60	258.0	155.5	0.0	0.9	108.0	209.6	47.5
61-90	5.6	5.7	0.0	0.0	5.7	5.6	0.0
91-180	61.1	76.9	0.3	0.0	21.6	6.1	55.0
>180	34.9	32.0	0.0	0.0	7.0	9.9	25.0
Total	1103.3	826.9	347.1	333.4	248.3	538.5	231.5

* 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	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %		1.3 %	-0.1 %	0.7 %
15-35	1.2 %		1.2 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.2 %		1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-		1.9 %	0.7 %	1.3 %
91-180	1.2 %		2.1 %	1.1 %	1.4 %
>180	1.8 %		2.3 %	1.3 %	1.7 %
Total	1.4 %		1.3 %	0.7 %	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	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	217	5158	4563	16	104	3192	3250	8	112	3742	3669
Intragrupo y off-shore***	0	0	1661	1977	0	0	1085	709	0	0	1383	1099
Otros	217	36	1638	1916	104	16	1084	1402	112	8	1383	1740
Total	253	253	8457	8457	120	120	5361	5361	121	121	6508	6508

* 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.