

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1959.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.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	296.8	163.4	72.0	168.0	30.7	68.1	60.7
15-35	762.2	630.3	219.4	220.5	107.8	238.6	303.1
36-60	152.9	106.2	0.0	0.0	106.2	152.9	0.0
61-90	12.0	30.1	3.5	0.7	21.6	6.3	5.0
91-180	5.7	40.8	0.2	0.0	35.6	0.7	5.0
>180	60.9	116.9	60.0	10.0	11.9	5.9	45.0
Total	1290.6	1087.6	355.0	399.2	313.8	472.6	418.8

* 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	0.6 %	1.1 %	0.6 %	0.7 %
15-35	0.7 %	0.9 %	0.7 %	0.8 %
36-60	-	1.1 %	0.9 %	1.0 %
61-90	0.8 %	1.3 %	0.9 %	1.2 %
91-180	1.0 %	2.3 %	0.9 %	2.1 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
Total	0.8 %	1.1 %	0.7 %	0.9 %

* 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**	38	202	5293	4786	35	103	3310	3318	14	114	4039	3776
Intragrupo y off-shore***	0	0	1842	2083	0	0	1102	746	0	0	1388	1288
Otros	202	38	1658	1924	103	35	1105	1453	114	14	1446	1809
Total	240	240	8793	8793	138	138	5516	5516	128	128	6873	6873

* 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.