

Fecha de Publicación: 4 de mayo de 2018

Fecha de Información: 02 de mayo 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\$2237.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.4%.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	376.4	355.4	179.7	181.0	34.7	54.4	141.0
15-35	650.6	650.4	187.0	252.8	159.4	93.8	304.0
36-60	301.2	241.2	45.0	0.9	131.2	235.3	65.0
61-90	2.6	7.7	0.0	0.0	7.7	2.6	0.0
91-180	69.0	13.4	0.0	65.0	13.4	4.0	0.0
>180	41.1	38.1	30.0	0.0	8.1	41.1	0.0
Total	1440.9	1306.3	441.7	499.7	354.6	431.3	510.0

* 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	0.9 %	0.4 %	-0.5 %	0.2 %
15-35	0.3 %	0.5 %	0.3 %	0.4 %
36-60	0.4 %	0.7 %	0.5 %	0.6 %
61-90	-	1.0 %	0.5 %	0.9 %
91-180	-	1.7 %	0.8 %	1.0 %
>180	-	1.5 %	1.4 %	1.5 %
Total	0.5 %	0.6 %	0.2 %	0.4 %

*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	30 de abr. al 4 de mayo				7 al 11 de mayo				14 al 18 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	111	3830	3789	26	115	4280	3940	17	126	3588	3441
Intragrupo y off-shore***	0	0	1372	1104	0	0	1439	1423	0	0	1275	769
Otros	111	35	1164	1473	114	26	1524	1880	126	17	979	1632
Total	146	146	6366	6366	140	140	7243	7243	143	143	5842	5842

* 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.