

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 | |
| 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: $((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.