

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2018

Fecha de Información: 03 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\$2062.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	201.0	205.5	106.0	63.0	23.0	61.5	76.5
15-35	596.3	855.0	300.5	176.5	371.7	237.0	182.8
36-60	167.0	159.3	0.0	0.0	149.3	157.0	10.0
61-90	17.5	26.1	20.0	0.0	6.1	17.5	0.0
91-180	20.7	23.6	0.0	1.4	13.6	9.2	10.0
>180	53.8	32.4	10.0	10.0	6.4	27.8	16.0
Total	1056.2	1301.9	436.5	250.9	570.1	510.0	295.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.5 %	0.6 %	-0.3 %	0.2 %
15-35	0.5 %	0.6 %	0.4 %	0.5 %
36-60	0.6 %	0.5 %	0.4 %	0.5 %
61-90	-	0.9 %	0.6 %	0.8 %
91-180	0.9 %	1.8 %	0.3 %	1.1 %
>180	1.5 %	2.2 %	1.1 %	1.4 %
Total	0.6 %	0.6 %	0.3 %	0.5 %

* 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**	34	111	3884	3841	31	114	4355	4058	20	129	3653	3485
Intragruppo y off-shore***	0	0	1400	1139	0	0	1517	1451	0	0	1275	769
Otros	111	34	1169	1472	114	31	1547	1911	129	20	984	1657
Total	145	145	6453	6453	145	145	7419	7419	148	148	5911	5911

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.