

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2018

Fecha de Información: 04 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\$1390.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.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	380.6	380.0	60.0	113.3	83.9	31.4	236.0
15-35	472.7	428.6	117.8	193.5	121.3	89.7	189.5
36-60	38.5	83.3	0.1	0.0	46.7	2.0	36.5
61-90	2.9	21.1	0.1	0.0	21.0	2.9	0.0
91-180	9.2	18.1	0.2	0.0	15.9	7.2	2.0
>180	16.4	13.2	0.2	0.0	3.0	6.4	10.0
Total	920.4	944.2	178.3	306.8	291.9	139.6	474.0

* 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	0.6 %		0.9 %	0.1 %	0.5 %
15-35	0.7 %		0.8 %	0.6 %	0.7 %
36-60	0.6 %		1.2 %	0.4 %	0.9 %
61-90	-		1.3 %	0.7 %	1.2 %
91-180	1.2 %		1.8 %	0.8 %	1.4 %
>180	1.6 %		1.8 %	1.3 %	1.5 %
Total	0.7 %		0.9 %	0.4 %	0.7 %

*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	34	113	4592	4301	20	133	3793	3616
Intragrupo y off-shore***	0	0	1400	1139	0	0	1571	1499	0	0	1281	834
Otros	111	34	1168	1472	113	34	1571	1934	133	20	1038	1661
Total	145	145	6452	6452	147	147	7735	7735	153	153	6111	6111

* 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.