Fecha de Publicación: 11 de abril de 2018

Fecha de Información: 09 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$1546.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.[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	359.0	340.3	213.0	277.0	65.3	20.0	62.0
15-35	464.7	437.8	160.5	147.0	145.3	185.7	132.0
36-60	14.8	9.0	0.0	10.0	9.0	4.8	0.0
61-90	2.9	20.0	0.0	0.0	20.0	2.9	0.0
91-180	4.7	27.3	0.0	0.0	27.3	4.7	0.0
>180	19.7	40.1	30.0	19.0	10.1	0.7	0.0
Total	**865.8**	**874.4**	**403.5**	**453.0**	**276.9**	**218.8**	**194.0**

* 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	1.7 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.4 %	1.7 %	2.0 %
61-90	-	2.2 %	1.7 %	2.1 %
91-180	-	2.3 %	1.8 %	2.2 %
>180	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %

*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	9 al 13 de abril				16 al 20 de abril				23 al 27 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	150	4045	3666	26	120	3902	3532	7	194	4007	3521
Intragrupo y off-shore***	0	0	1192	1432	0	0	1298	1297	0	0	1054	1342
Otros	150	21	1256	1396	120	26	1275	1645	194	7	1505	1703
Total	**171**	**171**	**6493**	**6493**	**147**	**147**	**6474**	**6474**	**201**	**201**	**6566**	**6566**

* 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.