Fecha de Publicación: 23 de abril de 2018

Fecha de Información: 19 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$2449.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[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	232.3	228.3	124.7	97.0	23.5	55.3	80.0
15-35	970.4	944.2	274.0	136.2	465.2	629.2	205.0
36-60	17.2	1.3	0.0	0.0	1.3	17.2	0.0
61-90	203.1	100.9	20.0	129.8	13.8	6.2	67.1
91-180	0.1	16.4	0.0	0.0	16.4	0.1	0.0
>180	55.1	57.7	12.0	30.0	20.7	0.1	25.0
Total	**1478.2**	**1348.8**	**430.8**	**393.1**	**540.9**	**708.0**	**377.1**

* 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	1.3 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	-	1.9 %	1.0 %	1.0 %
61-90	1.4 %	1.9 %	1.4 %	1.4 %
91-180	-	2.2 %	1.3 %	2.1 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %

*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	16 al 20 de abril				23 al 27 de abril				30 de abr. al 4 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	130	4904	4598	29	203	4553	4155	11	105	3020	2996
Intragrupo y off-shore***	0	0	1842	1736	0	0	1355	1514	0	0	928	697
Otros	130	33	1316	1728	203	29	1628	1868	105	11	1063	1319
Total	**163**	**163**	**8062**	**8062**	**233**	**233**	**7537**	**7537**	**116**	**116**	**5011**	**5011**

* 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.