Fecha de Publicación: 24 de abril de 2018

Fecha de Información: 20 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$1026.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.[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	273.9	225.3	133.0	161.0	10.3	30.9	82.0
15-35	210.5	327.7	220.8	97.0	62.0	68.5	45.0
36-60	6.1	9.7	0.0	0.0	9.7	6.1	0.0
61-90	18.3	9.7	0.0	15.0	8.7	2.3	1.0
91-180	1.7	39.4	0.0	0.0	39.4	1.7	0.0
>180	22.5	14.3	0.0	10.0	9.3	7.5	5.0
Total	**533.0**	**626.2**	**353.8**	**283.0**	**139.4**	**117.0**	**133.0**

* 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	1.1 %	1.2 %	0.8 %	1.0 %
15-35	1.1 %	1.1 %	1.1 %	1.1 %
36-60	-	1.9 %	0.4 %	1.3 %
61-90	1.0 %	2.0 %	0.7 %	1.7 %
91-180	-	2.1 %	1.1 %	2.0 %
>180	1.7 %	2.1 %	1.0 %	1.4 %
Total	1.1 %	1.3 %	0.9 %	1.1 %

*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**	31	127	4909	4593	33	208	4774	4298	12	104	3069	3081
Intragrupo y off-shore***	0	0	1842	1736	0	0	1443	1673	0	0	973	699
Otros	127	31	1311	1733	208	33	1636	1883	104	12	1069	1331
Total	**157**	**157**	**8062**	**8062**	**241**	**241**	**7854**	**7854**	**116**	**116**	**5111**	**5111**

* 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.