

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2018

Fecha de Información: 09 de mayo de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1832.4 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	253.4	399.3	229.2	91.5	52.1	43.9	118.0
15-35	511.6	500.2	239.5	178.5	49.2	121.6	211.5
36-60	25.8	12.9	0.0	0.0	12.9	25.8	0.0
61-90	134.2	87.1	13.0	0.0	44.1	104.2	30.0
91-180	40.1	56.9	24.2	25.0	22.8	5.1	10.0
>180	167.7	44.7	10.0	35.0	2.7	100.7	32.0
Total	1132.9	1101.1	515.9	330.0	183.7	401.4	401.5

* 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	1.5 %		1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.3 %		1.4 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-		2.2 %	1.1 %	1.4 %
61-90	1.2 %		1.3 %	1.1 %	1.2 %
91-180	1.2 %		1.8 %	0.9 %	1.5 %
>180	1.8 %		1.7 %	1.3 %	1.5 %
Total	1.4 %		1.4 %	1.1 %	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	7 al 11 de mayo				14 al 18 de mayo				21 al 25 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	111	5093	4862	23	131	4110	3993	37	138	3696	4025
Intragrupo y off-shore***	0	0	1900	1800	0	0	1403	862	0	0	1636	930
Otros	111	36	1628	1959	131	23	1093	1751	138	37	1495	1871
Total	147	147	8621	8621	154	154	6606	6606	175	175	6827	6827

* 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.