

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2018

Fecha de Información: 10 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\$1954.2 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	332.5	352.7	213.0	157.0	42.7	78.5	97.0
15-35	588.7	609.3	136.7	185.5	292.6	223.2	180.0
36-60	160.8	120.1	0.0	0.0	10.1	50.8	110.0
61-90	51.4	66.6	0.0	0.0	56.6	41.4	10.0
91-180	10.2	35.0	0.0	0.0	25.0	0.2	10.0
>180	25.0	13.9	0.0	0.0	8.9	20.0	5.0
Total	1168.6	1197.6	349.7	342.5	435.9	414.1	412.0

* 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	1.4 %		1.2 %	0.9 %	1.1 %
15-35	1.0 %		1.1 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.1 %		1.5 %	1.0 %	1.1 %
61-90	1.2 %		1.3 %	1.1 %	1.2 %
91-180	1.1 %		1.2 %	1.0 %	1.2 %
>180	1.7 %		2.0 %	1.3 %	1.5 %
Total	1.1 %		1.2 %	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	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**	34	111	5239	4947	25	135	4248	4154	39	137	3743	4127
Intragrupo y off-shore***	0	0	1944	1907	0	0	1502	903	0	0	1706	939
Otros	111	34	1629	1958	135	25	1114	1806	137	39	1512	1895
Total	146	146	8812	8812	160	160	6864	6864	176	176	6961	6961

* 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.