

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2018

Fecha de Información: 11 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\$1787.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	254.4	300.0	228.5	178.0	23.3	28.2	48.2
15-35	583.8	614.1	288.5	216.0	121.6	163.8	204.0
36-60	51.6	52.6	0.0	0.0	52.6	51.6	0.0
61-90	92.4	87.1	20.0	30.0	7.1	2.4	60.0
91-180	20.0	46.2	10.0	10.0	30.2	4.0	6.0
>180	0.0	3.7	0.0	0.0	3.7	0.0	0.0
Total	1002.2	1103.6	547.0	434.0	238.4	250.0	318.2

* 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	2.1 %	1.2 %	0.8 %	1.1 %
15-35	1.4 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.4 %	1.1 %	1.2 %
61-90	1.2 %	1.6 %	1.3 %	1.3 %
91-180	1.2 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
>180	-	1.6 %	-	1.6 %
Total	1.5 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %

* 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	109	5239	4948	26	139	4482	4413	40	138	3761	4164
Intragrupo y off-shore***	0	0	1944	1907	0	0	1694	1070	0	0	1742	950
Otros	109	34	1630	1958	139	26	1132	1825	138	40	1513	1901
Total	144	144	8813	8813	165	165	7308	7308	178	178	7016	7016

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.