

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2018

Fecha de Información: 15 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\$1754.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	350.0	359.0	138.5	136.5	62.5	55.5	158.0
15-35	411.5	510.0	347.5	150.0	83.5	182.5	79.0
36-60	98.7	89.4	5.0	0.0	84.4	98.7	0.0
61-90	41.1	19.0	0.0	0.0	19.0	41.1	0.0
91-180	47.7	32.8	10.7	30.8	10.4	5.2	11.7
>180	39.1	9.6	0.0	15.0	4.6	19.1	5.0
Total	988.0	1019.9	501.7	332.3	264.5	402.0	253.7

* 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	1.8 %	2.0 %	1.3 %	1.7 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	1.4 %	1.3 %	1.3 %
61-90	-	1.8 %	1.1 %	1.3 %
91-180	1.4 %	1.7 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.7 %	2.0 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.8 %	1.9 %	1.4 %	1.7 %

* 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	14 al 18 de mayo				21 al 25 de mayo				28 de may. al 1 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	138	4655	4597	44	139	3918	4338	5	158	3901	3767
Intragruppo y off-shore***	0	0	1823	1207	0	0	1751	950	0	0	1395	1357
Otros	138	26	1163	1839	139	44	1552	1934	158	5	1277	1448
Total	164	164	7642	7642	183	183	7221	7221	162	162	6572	6572

* 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.