

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2018

Fecha de Información: 16 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\$2224.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	386.6	267.4	101.5	202.0	21.9	40.6	144.0
15-35	724.0	862.6	280.1	105.3	185.1	221.2	397.5
36-60	155.9	174.5	0.0	0.0	174.5	155.9	0.0
61-90	84.7	98.0	0.0	0.0	18.0	4.7	80.0
91-180	27.5	51.3	0.0	0.0	26.3	2.5	25.0
>180	25.1	33.8	5.0	0.0	8.8	5.1	20.0
Total	1403.7	1487.7	386.6	307.3	434.6	429.9	666.5

* 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	
3-14	1.9 %	2.2 %	1.1 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.5 %	2.0 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.4 %	1.8 %	1.2 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.5 %	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**	27	140	4816	4687	44	139	4100	4477	8	160	3946	3883
Intragrupo y off-shore***	0	0	1863	1299	0	0	1808	1054	0	0	1465	1363
Otros	140	27	1166	1858	139	44	1559	1937	160	8	1302	1468
Total	167	167	7844	7844	183	183	7468	7468	168	168	6714	6714

* 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.