Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2018

Fecha de Información: 08 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$2460.9 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	268.5	253.4	133.5	136.5	40.9	53.0	79.0
15-35	533.2	912.8	655.5	136.0	58.3	198.2	199.0
36-60	277.6	90.8	0.0	60.0	75.8	202.6	15.0
61-90	81.0	48.8	0.0	0.0	48.8	81.0	0.0
91-180	123.1	39.0	10.0	90.0	8.0	12.1	21.0
>180	100.0	81.8	38.5	0.0	8.3	65.0	35.0
Total	**1383.4**	**1426.5**	**837.5**	**422.5**	**240.0**	**611.9**	**349.0**

* 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 %	1.3 %	0.8 %	1.1 %
15-35	1.3 %	1.3 %	0.9 %	1.2 %
36-60	1.4 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
61-90	-	0.8 %	0.7 %	0.8 %
91-180	1.2 %	1.4 %	1.1 %	1.1 %
>180	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
Total	1.4 %	1.3 %	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**	36	113	4968	4702	23	129	4020	3864	36	138	3655	3903
Intragrupo y off-shore***	0	0	1810	1743	0	0	1322	837	0	0	1568	920
Otros	112	36	1627	1959	129	23	1075	1716	138	36	1461	1860
Total	**149**	**149**	**8404**	**8404**	**152**	**152**	**6417**	**6417**	**174**	**174**	**6683**	**6683**

* 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.