

Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2018

Fecha de Información: 17 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\$2303.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	345.0	309.5	211.5	172.0	9.0	84.0	89.0
15-35	565.8	845.7	551.4	87.5	92.3	276.3	202.0
36-60	189.8	34.3	0.0	0.0	34.3	189.8	0.0
61-90	35.9	13.2	0.0	0.0	3.2	25.9	10.0
91-180	31.5	13.9	0.0	20.0	12.9	10.5	1.0
>180	193.1	52.7	14.0	148.5	13.7	19.6	25.0
Total	1361.1	1269.2	776.9	428.0	165.3	606.1	327.0

* 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	1.7 %	1.1 %	0.6 %	1.0 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	2.9 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.6 %	2.0 %	1.3 %	1.5 %
91-180	1.3 %	1.9 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %

* 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

Sector	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	146	4891	4763	47	139	4281	4670	8	160	4036	3939
Intragrupo y off-shore***	0	0	1903	1363	0	0	1945	1162	0	0	1499	1366
Otros	146	27	1182	1851	139	47	1561	1955	160	8	1309	1539
Total	173	173	7976	7976	187	187	7787	7787	168	168	6844	6844

* 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.