

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2018

Fecha de Información: 18 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\$1901.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	347.7	405.2	229.5	158.0	42.7	56.7	133.0
15-35	335.0	582.4	306.5	92.5	145.9	112.5	130.0
36-60	161.5	102.7	0.0	0.0	102.7	161.5	0.0
61-90	37.5	42.6	26.0	0.4	6.6	27.1	10.0
91-180	69.9	65.6	0.7	23.0	34.8	16.9	30.0
>180	36.7	27.6	10.1	0.0	7.4	26.7	10.0
Total	988.2	1226.1	572.9	273.9	340.2	401.3	313.0

* 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	1.9 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.2 %	1.5 %
91-180	1.6 %	2.0 %	1.3 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %

* 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	141	4891	4770	49	141	4481	4873	11	168	4179	4137
Intragrupo y off-shore***	0	0	1903	1363	0	0	2121	1320	0	0	1553	1366
Otros	141	27	1189	1851	141	49	1578	1987	168	11	1330	1559
Total	168	168	7983	7983	190	190	8180	8180	178	178	7062	7062

* 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.