

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2018

Fecha de Información: 21 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\$1946.8 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	185.1	158.1	56.0	80.0	44.1	47.1	58.0
15-35	610.6	643.5	148.2	224.0	306.4	197.7	188.9
36-60	239.2	179.6	0.2	0.0	179.4	239.2	0.0
61-90	24.3	8.1	0.1	0.0	8.0	24.3	0.0
91-180	13.1	47.8	0.0	0.0	47.8	13.1	0.0
>180	47.6	41.7	30.0	40.0	6.7	2.6	5.0
Total	1119.9	1078.8	234.5	344.0	592.4	524.0	251.9

* 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 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.8 %
>180	1.7 %	2.1 %	1.6 %	1.9 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.7 %	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	21 al 25 de mayo				28 de may. al 1 de junio				4 al 8 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	145	4598	4943	11	168	4246	4219	27	120	2822	3382
Intragrupo y off-shore***	0	0	2143	1375	0	0	1587	1391	0	0	1662	1005
Otros	145	52	1597	2020	168	11	1350	1572	120	27	808	905
Total	197	197	8338	8338	180	180	7183	7183	147	147	5292	5292

* 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.