

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2018

Fecha de Información: 22 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\$2169.8 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	527.7	411.8	168.9	284.3	25.9	26.4	217.0
15-35	635.9	614.3	175.0	350.6	270.3	116.3	169.0
36-60	55.2	106.2	10.0	0.0	86.2	45.2	10.0
61-90	3.1	10.9	0.0	0.0	10.9	3.1	0.0
91-180	21.6	48.4	0.0	0.0	38.4	11.6	10.0
>180	102.1	88.6	25.0	35.0	13.6	17.1	50.0
Total	1345.5	1280.3	378.9	669.9	445.4	219.6	456.0

* 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 %	2.5 %	1.6 %	1.9 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.6 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.1 %	1.3 %	1.9 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
Total	1.8 %	2.1 %	1.6 %	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	146	4951	5186	12	175	4419	4371	28	123	2844	3428
Intragrupo y off-shore***	0	0	2257	1572	0	0	1643	1478	0	0	1667	1010
Otros	146	52	1588	2037	175	12	1367	1580	123	28	834	907
Total	198	198	8795	8795	187	187	7429	7429	152	152	5345	5345

* 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.