

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1847.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	305.4	220.6	81.0	182.0	45.1	28.9	94.5
15-35	569.4	672.8	261.0	152.0	229.1	234.7	182.7
36-60	125.9	91.2	0.0	1.7	91.2	124.2	0.0
61-90	28.0	30.1	0.0	0.0	5.1	3.0	25.0
91-180	24.3	19.7	0.0	10.0	14.7	9.3	5.0
>180	50.3	32.3	12.0	31.1	5.3	4.2	15.0
Total	1103.2	1066.8	354.0	376.8	390.6	404.2	322.2

* 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	1.8 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.3 %	3.2 %	1.4 %	1.6 %
91-180	1.4 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %

* 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**	51	147	5157	5236	13	177	4486	4482	30	124	2944	3520
Intragrupo y off-shore***	0	0	2287	1734	0	0	1694	1498	0	0	1667	1024
Otros	147	51	1573	2047	177	13	1393	1592	124	30	845	912
Total	199	199	9017	9017	191	191	7573	7573	153	153	5457	5457

* 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.