

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2018

Fecha de Información: 24 de mayo de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1901.2 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	223.1	232.2	83.0	70.0	36.2	40.1	113.0
15-35	805.8	648.4	297.8	174.2	118.6	399.6	232.0
36-60	54.0	52.2	0.0	0.0	52.2	54.0	0.0
61-90	75.4	93.2	0.0	0.3	73.2	55.1	20.0
91-180	0.3	30.4	0.0	0.0	30.4	0.3	0.0
>180	35.1	51.1	15.0	0.0	1.1	0.1	35.0
Total	1193.7	1107.4	395.8	244.6	311.6	549.1	400.0

* 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 %		1.2 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-		1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.4 %		1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-		2.0 %	1.4 %	2.0 %
>180	1.6 %		2.5 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.7 %		1.7 %	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**	49	146	5197	5250	15	173	4627	4665	30	124	2987	3560
Intragrupo y off-shore***	0	0	2292	1749	0	0	1772	1536	0	0	1667	1041
Otros	146	49	1582	2072	173	15	1404	1602	124	30	865	918
Total	195	195	9071	9071	188	188	7803	7803	154	154	5519	5519

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.