

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2018

Fecha de Información: 28 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\$266.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70.3	79.5	77.2	49.0	2.3	21.3	0.0
15-35	62.5	35.1	8.0	42.0	27.1	20.5	0.0
36-60	1.3	11.5	2.5	0.0	9.0	1.3	0.0
61-90	0.0	0.2	0.0	0.0	0.2	0.0	0.0
91-180	0.0	5.7	0.0	0.0	5.7	0.0	0.0
>180	0.1	0.4	0.0	0.0	0.4	0.1	0.0
Total	134.1	132.5	87.7	91.0	44.8	43.1	0.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	1.4 %	1.4 %	1.4 %
15-35	-	2.3 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	2.1 %	-	2.1 %
91-180	-	2.2 %	-	2.2 %
>180	-	2.1 %	1.5 %	2.0 %
Total	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %

*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	28 de may. al 1 de junio				4 al 8 de junio				11 al 15 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	175	5089	5224	31	125	3140	3591	30	122	3774	3774
Intragruppo y off-shore***	0	0	2319	1970	0	0	1674	1137	0	0	1256	825
Otros	175	31	1416	1630	125	31	870	955	122	30	1300	1732
Total	206	206	8825	8825	155	155	5684	5684	152	152	6330	6330

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.