

Fecha de Publicación: 1 de junio de 2018

Fecha de Información: 30 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\$2933.1 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	808.0	669.3	415.0	565.8	48.0	36.0	206.3
15-35	650.2	746.1	252.8	201.5	130.1	85.5	363.3
36-60	249.1	102.3	0.0	0.0	102.3	249.1	0.0
61-90	31.5	52.4	0.0	0.0	22.4	1.5	30.0
91-180	33.3	80.5	50.0	30.0	30.5	3.3	0.0
>180	72.3	52.6	25.0	55.0	12.6	2.3	15.0
Total	1844.4	1703.2	742.8	852.2	345.9	377.7	614.5

* 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 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %		2.1 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-		1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.6 %		1.8 %	1.3 %	1.7 %
91-180	-		2.1 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.8 %		1.9 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.8 %		1.9 %	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	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	179	5957	5940	41	128	3440	3812	38	123	3935	3954
Intragrupo y off-shore***	0	0	2801	2584	0	0	1698	1203	0	0	1295	825
Otros	179	31	1405	1639	128	41	934	1057	123	38	1353	1804
Total	211	211	10163	10163	169	169	6072	6072	162	162	6583	6583

* 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.