

Fecha de Publicación: 5 de junio de 2018

Fecha de Información: 31 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\$1852.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	128.7	151.7	41.8	40.0	64.9	43.7	45.0
15-35	404.9	692.4	426.2	85.7	160.2	213.1	106.0
36-60	279.6	117.8	0.0	0.0	117.8	279.6	0.0
61-90	41.5	16.3	0.0	20.0	6.3	11.5	10.0
91-180	62.9	30.8	0.0	40.0	20.8	12.9	10.0
>180	71.6	60.6	20.0	35.0	5.6	1.6	35.0
Total	989.2	1069.6	487.9	220.7	375.7	562.4	206.0

* 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	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.5 %	2.0 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.7 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.5 %	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**	29	184	5991	5970	44	131	3504	3859	39	123	3964	4019
Intragrupo y off-shore***	0	0	2815	2601	0	0	1716	1226	0	0	1305	825
Otros	184	29	1411	1647	131	44	948	1082	123	39	1388	1814
Total	213	213	10218	10218	175	175	6168	6168	162	162	6658	6658

* 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 intragrupo.