

Fecha de Publicación: 7 de junio de 2018

Fecha de Información: 05 de junio 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\$1593.6 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	304.4	249.7	62.0	151.3	119.6	84.9	68.2
15-35	262.9	361.7	258.0	88.0	62.2	133.4	41.5
36-60	148.2	189.1	1.5	0.0	187.6	148.2	0.0
61-90	14.3	10.9	0.0	0.0	10.9	14.3	0.0
91-180	93.1	46.9	0.0	0.0	31.9	78.1	15.0
>180	17.4	34.6	0.0	0.0	19.6	2.4	15.0
Total	840.3	893.0	321.5	239.3	431.9	461.3	139.7

* 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 %	2.0 %	1.2 %	1.5 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	1.5 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	1.8 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.9 %	2.2 %	1.6 %	2.0 %
Total	1.6 %	1.8 %	1.4 %	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	4 al 8 de junio				11 al 15 de junio				18 al 22 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	128	3845	4118	45	122	4105	4132	36	104	4640	4595
Intragrupo y off-shore***	0	0	1836	1483	0	0	1347	840	0	0	1768	1458
Otros	128	37	1006	1085	122	45	1409	1889	104	36	1487	1842
Total	165	165	6687	6687	167	167	6861	6861	140	140	7895	7895

* 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.