

Fecha de Publicación: 8 de junio de 2018

Fecha de Información: 06 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\$1856.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	425.7	227.0	53.3	286.5	61.7	27.2	112.0
15-35	295.9	328.3	215.0	127.5	32.3	87.4	81.0
36-60	255.5	160.2	0.0	0.0	160.2	255.5	0.0
61-90	5.1	76.9	11.7	0.0	65.1	5.1	0.0
91-180	80.3	143.0	54.7	0.0	58.3	50.3	30.0
>180	42.0	59.7	15.3	20.9	24.4	1.1	20.0
Total	1104.5	995.0	350.0	434.9	402.0	426.6	243.0

* 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 %	1.5 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
91-180	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.0 %	1.9 %	1.5 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %

*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**	38	127	4091	4181	45	128	4237	4285	36	104	4705	4626
Intragrupo y off-shore***	0	0	1839	1700	0	0	1390	885	0	0	1775	1484
Otros	127	38	1045	1095	128	45	1437	1894	104	36	1492	1862
Total	164	164	6976	6976	173	173	7063	7063	140	140	7972	7972

* 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.