

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2018

Fecha de Información: 08 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\$1579.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	247.0	313.1	103.5	61.5	97.6	73.5	112.0
15-35	359.0	494.7	351.3	136.7	7.9	86.8	135.5
36-60	32.8	31.9	0.0	0.0	31.9	32.8	0.0
61-90	55.1	8.2	0.0	50.0	8.2	5.1	0.0
91-180	147.4	61.7	0.0	0.0	29.7	115.4	32.0
>180	75.0	38.7	30.0	0.0	3.7	70.0	5.0
Total	916.2	948.2	484.8	248.2	179.0	383.5	284.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.5 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	2.2 %	1.2 %	1.8 %
91-180	1.4 %	1.9 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.3 %	1.5 %	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	122	4124	4204	56	146	4463	4699	49	115	4984	4800
Intragruppo y off-shore***	0	0	1844	1713	0	0	1545	942	0	0	1810	1576
Otros	122	38	1043	1095	136	46	1583	1949	105	39	1523	1941
Total	159	159	7012	7012	192	192	7590	7590	154	154	8317	8317

* 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 intragruppo.