Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2018

Fecha de Información: 25 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$1996.3 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	559.8	503.7	477.5	481.5	6.2	58.3	20.0
15-35	307.2	607.0	404.7	55.0	74.3	124.2	128.0
36-60	4.4	2.3	0.0	0.0	2.3	4.4	0.0
61-90	10.0	8.6	0.0	0.0	8.6	10.0	0.0
91-180	50.4	26.9	0.0	0.0	26.9	50.4	0.0
>180	58.0	16.0	0.0	40.0	6.0	8.0	10.0
Total	**989.9**	**1164.4**	**882.2**	**576.5**	**124.2**	**255.4**	**158.0**

* 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	1.7 %	2.4 %	1.1 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	0.7 %	1.3 %
91-180	-	1.9 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.7 %	2.3 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.3 %	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	21 al 25 de mayo				28 de may. al 1 de junio				4 al 8 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	145	5197	5252	21	175	5068	5145	31	125	3101	3589
Intragrupo y off-shore***	0	0	2292	1749	0	0	2242	1957	0	0	1674	1101
Otros	145	46	1584	2072	175	21	1414	1622	125	31	867	952
Total	**192**	**192**	**9073**	**9073**	**196**	**196**	**8724**	**8724**	**155**	**155**	**5643**	**5643**

* 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.