

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2018

Fecha de Información: 01 de junio de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1699.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	245.7	188.4	103.5	122.0	21.9	60.7	63.0
15-35	609.8	609.4	212.5	204.5	23.9	32.3	373.0
36-60	120.1	62.4	0.0	0.0	62.4	120.1	0.0
61-90	11.1	4.5	0.0	10.0	4.5	1.1	0.0
91-180	65.3	133.7	50.0	0.0	33.7	15.3	50.0
>180	95.0	70.3	20.0	60.0	20.3	5.0	30.0
Total	1147.1	1068.8	386.0	396.5	166.8	234.6	516.0

* 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 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.5 %		1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-		1.5 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-		2.2 %	1.5 %	1.7 %
91-180	1.5 %		1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.7 %		2.4 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.5 %		1.6 %	1.3 %	1.5 %

*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	181	5990	5971	41	136	3692	4031	40	125	4021	4029
Intragrupo y off-shore***	0	0	2815	2601	0	0	1818	1348	0	0	1306	825
Otros	181	29	1413	1647	136	41	953	1085	125	40	1397	1870
Total	210	210	10218	10218	176	176	6464	6464	166	166	6724	6724

* 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.