

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2018

Fecha de Información: 19 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\$2049.0 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 | 158.6 | 248.5 | 163.0 | 112.5 | 65.5 | 26.1 | 20.0 |
| 15-35 | 423.5 | 615.4 | 444.0 | 133.3 | 32.4 | 151.3 | 139.0 |
| 36-60 | 262.0 | 337.2 | 10.0 | 20.2 | 307.2 | 221.7 | 20.0 |
| 61-90 | 4.4 | 2.0 | 0.0 | 0.0 | 2.0 | 4.4 | 0.0 |
| 91-180 | 53.8 | 43.6 | 10.0 | 10.0 | 23.6 | 33.8 | 10.0 |
| >180 | 83.1 | 30.9 | 0.0 | 45.0 | 5.9 | 13.1 | 25.0 |
| Total | 985.5 | 1277.6 | 627.0 | 321.0 | 436.6 | 450.5 | 214.0 |

* 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 % | 1.7 % | 1.2 % | 1.5 % |
| 15-35 | 1.8 % | 1.7 % | 1.5 % | 1.7 % |
| 36-60 | 1.6 % | 1.6 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 61-90 | - | 2.4 % | 1.2 % | 1.6 % |
| 91-180 | 1.6 % | 1.7 % | 1.4 % | 1.5 % |
| >180 | 1.8 % | 3.2 % | 1.7 % | 1.9 % |
| Total | 1.7 % | 1.7 % | 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 | 18 al 22 de junio | | | | 25 al 29 de junio | | | | 2 al 6 de julio | | | |
|----------------------------------|-------------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 36 | 123 | 6183 | 5979 | 12 | 176 | 3092 | 3862 | 20 | 72 | 1636 | 1499 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2512 | 2254 | 0 | 0 | 1788 | 988 | 0 | 0 | 673 | 477 |
| Otros | 123 | 36 | 1713 | 2174 | 175 | 12 | 1119 | 1150 | 72 | 20 | 331 | 663 |
| Total | 159 | 159 | 10407 | 10407 | 188 | 188 | 6000 | 6000 | 92 | 92 | 2639 | 2639 |

* 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.