

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2018

Fecha de Información: 14 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\$2058.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	309.6	291.7	158.0	117.1	12.7	71.5	121.0
15-35	346.4	626.9	439.0	64.5	50.7	144.6	137.3
36-60	330.7	205.5	0.0	0.0	205.5	330.7	0.0
61-90	37.9	45.3	30.0	25.0	5.3	2.9	10.0
91-180	89.8	31.0	0.6	65.0	20.4	14.8	10.0
>180	0.4	21.6	20.0	0.0	1.6	0.4	0.0
Total	1114.8	1221.9	647.6	271.6	296.1	564.9	278.3

* 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	1.3 %	1.4 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.3 %	1.2 %	1.3 %
61-90	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %
91-180	1.4 %	1.9 %	1.4 %	1.5 %
>180	-	1.8 %	2.3 %	1.9 %
Total	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %

*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	11 al 15 de junio				18 al 22 de junio				25 al 29 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	132	4925	4999	42	107	5462	5398	9	165	3009	3671
Intragrupo y off-shore***	0	0	1724	1274	0	0	2200	1740	0	0	1674	979
Otros	132	52	1615	1991	107	42	1598	2122	165	9	1068	1102
Total	184	184	8264	8264	149	149	9260	9260	174	174	5752	5752

* 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.