

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2018

Fecha de Información: 15 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\$1870.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	188.9	198.9	62.3	79.0	81.5	54.9	55.0
15-35	270.1	646.6	480.2	41.5	15.8	77.9	150.7
36-60	294.5	220.0	0.0	2.0	220.0	292.5	0.0
61-90	41.6	12.7	0.0	0.0	7.7	36.6	5.0
91-180	57.2	22.8	0.0	20.0	22.8	37.2	0.0
>180	113.5	64.5	0.0	25.0	14.5	38.5	50.0
Total	965.8	1165.5	542.5	167.5	362.2	537.6	260.7

* 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 %	1.6 %	0.7 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	1.3 %	1.2 %	1.3 %
61-90	1.4 %	2.6 %	1.3 %	1.5 %
91-180	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.8 %	2.0 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.2 %	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	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	109	5624	5537	9	165	3035	3735
Intragrupo y off-shore***	0	0	1724	1274	0	0	2236	1812	0	0	1701	986
Otros	132	52	1616	1991	109	42	1647	2157	164	9	1106	1121
Total	183	183	8265	8265	151	151	9506	9506	173	173	5842	5842

* 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.