

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2018

Fecha de Información: 20 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\$2500.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	126.7	206.7	140.0	67.5	33.7	26.2	33.0
15-35	464.2	584.1	257.0	166.2	79.1	50.0	248.0
36-60	626.5	500.8	20.0	54.0	475.8	567.5	5.0
61-90	52.6	58.5	0.0	0.0	58.5	52.6	0.0
91-180	118.4	29.9	3.4	55.0	6.5	43.4	20.0
>180	32.7	19.6	0.0	5.0	4.6	12.7	15.0
Total	1421.2	1399.8	420.4	347.7	658.4	752.5	321.0

* 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	
3-14	1.9 %	1.4 %	1.0 %	1.3 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %
36-60	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.6 %	2.4 %	1.5 %	1.5 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.5 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.5 %	1.7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	134	6261	6121	13	168	3127	3900	21	72	1670	1537
Intragrupo y off-shore***	0	0	2634	2310	0	0	1806	1005	0	0	673	477
Otros	134	36	1714	2178	168	13	1139	1167	72	21	339	667
Total	170	170	10609	10609	181	181	6072	6072	93	93	2681	2681

* 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.