

Fecha de Publicación: 29 de junio de 2018

Fecha de Información: 27 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\$1725.9 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	135.6	198.6	162.0	86.5	4.2	16.6	32.5
15-35	444.8	507.3	298.0	76.3	28.8	187.9	180.5
36-60	207.1	272.5	0.0	0.0	272.5	207.1	0.0
61-90	15.4	6.4	0.0	0.0	6.4	15.4	0.0
91-180	81.0	32.9	0.0	11.2	15.9	52.7	17.0
>180	35.8	38.4	10.0	3.6	8.4	12.2	20.0
Total	919.6	1056.2	470.0	177.7	336.3	492.0	250.0

* 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	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.8 %	1.9 %	1.6 %	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	25 al 29 de junio				2 al 6 de julio				9 al 13 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	178	4307	4713	35	71	1908	1971	17	119	3523	3599
Intragrupo y off-shore***	0	0	2292	1780	0	0	886	493	0	0	1387	915
Otros	178	17	1155	1261	71	35	362	692	119	17	1049	1444
Total	196	196	7754	7754	106	106	3155	3155	136	136	5959	5959

* 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.