

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2018

Fecha de Información: 28 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\$1705.4 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	341.2	122.1	22.0	220.5	6.1	26.7	94.0
15-35	414.5	662.1	372.2	113.0	83.2	94.8	206.7
36-60	189.3	59.7	0.0	10.0	59.7	179.3	0.0
61-90	9.1	72.2	0.0	0.0	72.2	9.1	0.0
91-180	11.4	66.7	20.0	0.0	36.7	1.4	10.0
>180	65.8	32.0	0.0	30.0	2.0	5.8	30.0
Total	1031.3	1014.9	414.2	373.5	260.0	317.1	340.7

* 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	1.6 %		2.6 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %		1.9 %	1.5 %	1.8 %
36-60	-		1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-		2.6 %	1.5 %	2.5 %
91-180	1.8 %		2.1 %	1.1 %	2.0 %
>180	1.9 %		2.2 %	1.5 %	1.8 %
Total	1.7 %		2.1 %	1.4 %	1.7 %

*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	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	4494	4723	36	71	1996	2025	17	119	3587	3660
Intragrupo y off-shore***	0	0	2302	1973	0	0	898	520	0	0	1387	915
Otros	178	17	1154	1254	71	36	360	709	119	17	1059	1458
Total	195	195	7950	7950	108	108	3254	3254	136	136	6032	6032

* 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.