

Fecha de Publicación: 5 de julio de 2018

Fecha de Información: 03 de julio 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\$1394.9 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	294.9	111.8	16.0	202.3	13.3	10.1	82.5
15-35	445.6	433.4	265.3	160.3	36.7	153.9	131.5
36-60	144.9	71.9	0.0	0.1	71.9	144.7	0.0
61-90	16.5	45.5	35.1	0.0	10.5	16.5	0.0
91-180	1.6	31.1	0.2	0.0	30.9	1.6	0.0
>180	2.2	9.4	0.0	0.0	9.4	2.2	0.0
Total	905.7	703.2	316.5	362.7	172.6	329.0	214.0

* 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	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %		1.0 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.8 %		1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-		1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-		2.3 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-		2.1 %	1.7 %	2.1 %
>180	-		2.1 %	1.8 %	2.0 %
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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de julio				9 al 13 de julio				16 al 20 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	82	2366	2248	18	118	3711	3717	22	119	4483	5278
Intragrupo y off-shore***	0	0	1024	791	0	0	1387	976	0	0	2709	1116
Otros	82	36	374	726	118	18	1073	1479	119	22	1015	1813
Total	118	118	3764	3764	136	136	6172	6172	142	142	8207	8207

* 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.