

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2018

Fecha de Información: 04 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\$120.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	81.2	81.4	0.0	0.0	1.4	1.2	80.0
15-35	5.3	23.0	5.0	5.0	18.0	0.3	0.0
36-60	0.2	1.8	0.0	0.0	1.8	0.2	0.0
61-90	0.0	2.0	0.0	0.0	2.0	0.0	0.0
91-180	0.0	2.9	0.0	0.0	2.9	0.0	0.0
>180	0.3	2.0	0.0	0.0	2.0	0.3	0.0
Total	87.1	113.0	5.0	5.0	28.0	2.1	80.0

* 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	2.1 %		4.5 %	0.8 %	2.2 %
15-35	-		2.1 %	1.6 %	2.0 %
36-60	-		2.4 %	1.5 %	2.3 %
61-90	-		2.2 %	1.0 %	2.2 %
91-180	-		2.2 %	-	2.2 %
>180	-		2.5 %	1.8 %	2.4 %
Total	2.1 %		2.3 %	1.5 %	2.1 %

*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	2385	2285	19	119	3770	3777	22	119	4484	5278
Intragrupo y off-shore***	0	0	1024	791	0	0	1387	976	0	0	2709	1116
Otros	82	36	392	725	119	19	1074	1478	119	22	1015	1814
Total	117	117	3801	3801	138	138	6231	6231	142	142	8208	8208

* 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.