

Fecha de Publicación: 9 de julio de 2018

Fecha de Información: 05 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\$1944.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	246.2	266.7	110.6	113.5	29.6	6.2	126.5
15-35	497.4	651.6	183.3	146.9	228.8	111.0	239.5
36-60	178.3	190.7	0.0	0.0	185.7	173.3	5.0
61-90	26.4	55.8	0.2	0.0	30.7	1.4	25.0
91-180	114.3	93.6	0.2	80.0	63.5	4.3	30.0
>180	36.5	37.5	0.0	0.0	12.5	11.5	25.0
Total	1099.1	1296.0	294.2	340.4	550.8	307.6	451.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	2.2 %	1.2 %	1.8 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
91-180	1.8 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.6 %	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

Sector	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	79	2473	2389	19	121	3890	3890	22	122	4525	5327
Intragruppo y off-shore***	0	0	1074	829	0	0	1448	1052	0	0	2709	1116
Otros	79	36	396	725	121	19	1089	1486	122	22	1024	1815
Total	115	115	3943	3943	139	139	6427	6427	144	144	8258	8258

* 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 intragruppo.