

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2018

Fecha de Información: 06 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\$1723.9 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	323.9	303.6	185.0	202.0	7.6	10.9	111.0
15-35	541.2	522.4	181.0	133.0	32.4	99.2	309.0
36-60	115.3	123.2	0.0	0.0	123.2	115.3	0.0
61-90	10.8	20.8	0.0	0.0	10.8	0.8	10.0
91-180	26.7	61.8	0.0	0.0	36.8	1.7	25.0
>180	44.2	120.4	75.0	8.9	10.4	0.3	35.0
Total	1061.9	1152.1	441.0	343.9	221.1	228.0	490.0

* 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	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.8 %	2.2 %	1.6 %	2.0 %
91-180	1.8 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.3 %	2.1 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.8 %	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**	35	79	2474	2390	21	124	4047	4122	22	125	4691	5391
Intragruppo y off-shore***	0	0	1074	829	0	0	1607	1129	0	0	2735	1241
Otros	79	35	396	725	124	21	1092	1494	125	22	1023	1816
Total	115	115	3944	3944	145	145	6745	6745	147	147	8448	8448

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.