

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2018

Fecha de Información: 09 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\$2016.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	245.5	241.2	90.0	100.0	38.2	32.5	113.0
15-35	337.6	499.7	364.5	104.5	29.2	127.1	106.0
36-60	323.3	275.3	0.0	10.0	270.3	308.3	5.0
61-90	30.7	62.3	30.0	0.0	2.3	0.7	30.0
91-180	136.7	28.2	0.0	120.0	18.2	6.7	10.0
>180	90.2	79.4	5.0	10.0	4.4	10.2	70.0
Total	1163.9	1186.2	489.5	344.5	362.7	485.4	334.0

* 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	1.9 %	1.8 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.9 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.9 %	2.0 %	0.6 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.6 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.9 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %

*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	9 al 13 de julio				16 al 20 de julio				23 al 27 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	127	4174	4257	22	124	4785	5473	15	113	3369	3569
Intragruppo y off-shore***	0	0	1692	1198	0	0	2740	1272	0	0	1591	1047
Otros	127	22	1089	1500	124	22	1060	1839	113	15	904	1249
Total	149	149	6955	6955	147	147	8585	8585	128	128	5864	5864

* 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.