

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.