

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2018

Fecha de Información: 10 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\$2398.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	396.2	407.2	137.0	187.0	106.2	45.2	164.0
15-35	672.9	780.2	372.0	175.5	65.7	154.9	342.5
36-60	241.2	141.8	0.1	0.0	141.7	241.2	0.0
61-90	31.5	35.5	0.0	30.0	35.5	1.5	0.0
91-180	70.6	43.5	10.0	70.0	33.5	0.6	0.0
>180	30.0	68.8	45.0	15.0	8.8	0.0	15.0
Total	1442.5	1477.0	564.1	477.5	391.3	443.5	521.5

* 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	2.0 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.7 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %

*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**	24	129	4205	4429	22	129	5057	5610	17	113	3536	3831
Intragrupa y off-shore***	0	0	1829	1206	0	0	2740	1451	0	0	1720	1047
Otros	129	24	1101	1501	129	22	1147	1882	113	17	909	1288
Total	153	153	7135	7135	151	151	8944	8944	130	130	6166	6166

* 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.