

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2018

Fecha de Información: 11 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\$2244.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	491.6	352.2	103.1	257.5	21.1	6.1	228.0
15-35	574.7	919.1	443.5	98.0	124.6	125.7	351.0
36-60	142.2	140.2	0.0	0.0	140.2	142.2	0.0
61-90	54.4	19.2	0.0	0.0	4.2	39.4	15.0
91-180	58.5	70.5	30.0	10.0	10.5	18.5	30.0
>180	30.7	15.1	0.0	0.0	15.1	30.7	0.0
Total	1352.0	1516.3	576.6	365.5	315.7	362.5	624.0

* 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	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.9 %	2.3 %	1.8 %	1.9 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
>180	-	2.2 %	1.8 %	1.9 %
Total	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %

*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**	23	129	4441	4500	23	130	5202	5759	17	113	3657	3984
Intragruppo y off-shore***	0	0	1886	1428	0	0	2765	1486	0	0	1750	1047
Otros	129	23	1102	1501	130	23	1165	1887	113	17	912	1289
Total	153	153	7429	7429	153	153	9132	9132	130	130	6320	6320

* 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.