

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2018

Fecha de Información: 12 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\$2271.9 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	477.4	486.7	133.8	189.0	93.9	29.4	259.0
15-35	637.4	728.6	352.9	176.8	108.4	193.3	267.3
36-60	155.2	161.4	0.0	0.0	161.4	155.2	0.0
61-90	48.1	39.9	0.0	0.0	14.9	23.1	25.0
91-180	15.3	27.4	0.0	0.0	27.4	15.3	0.0
>180	12.4	43.6	25.0	0.0	8.6	2.4	10.0
Total	1345.7	1487.5	511.6	365.8	414.5	418.7	561.3

* 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	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
15-35	1.9 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
61-90	2.0 %	2.3 %	1.7 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.8 %	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	4474	4503	23	127	5538	5993	16	115	3765	4308
Intragrupa y off-shore***	0	0	1887	1472	0	0	2785	1621	0	0	1936	1057
Otros	129	24	1104	1491	127	23	1195	1904	115	16	976	1312
Total	153	153	7466	7466	150	150	9518	9518	131	131	6677	6677

* 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 intragrupo.