

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2018

Fecha de Información: 13 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\$1788.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	360.7	239.3	90.1	264.0	80.2	27.7	69.0
15-35	454.1	645.6	318.5	232.8	132.1	26.3	195.0
36-60	82.4	42.7	0.0	0.0	42.7	82.4	0.0
61-90	21.3	22.7	0.0	4.8	22.7	16.5	0.0
91-180	2.0	47.8	0.0	0.0	47.8	2.0	0.0
>180	113.0	53.7	10.0	80.0	10.6	0.0	33.0
Total	1033.6	1051.8	418.7	581.6	336.1	155.0	297.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.2 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.3 %	1.7 %	2.1 %
91-180	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %

*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

Sectores	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	4476	4504	23	136	5877	6118	25	116	3778	4426
Intragrupa y off-shore***	0	0	1887	1472	0	0	2845	1885	0	0	1966	1057
Otros	129	24	1105	1492	136	23	1197	1915	116	25	1059	1320
Total	153	153	7468	7468	159	159	9918	9918	141	141	6803	6803

* 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.