

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2018

Fecha de Información: 16 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\$1476.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	249.0	146.9	46.0	125.0	20.3	43.3	80.6
15-35	438.0	647.1	327.0	107.5	42.6	53.0	277.5
36-60	121.7	118.5	0.0	0.0	118.5	121.7	0.0
61-90	5.9	16.4	0.0	0.0	16.4	5.9	0.0
91-180	4.8	7.8	0.0	0.0	7.8	4.8	0.0
>180	37.2	41.0	33.0	36.0	8.0	1.2	0.0
Total	856.5	977.7	406.0	268.5	213.6	229.9	358.1

* 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 %	2.2 %	2.4 %	2.3 %
15-35	2.1 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.2 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.2 %	1.9 %	2.1 %
91-180	-	2.4 %	1.9 %	2.2 %
>180	-	1.2 %	1.9 %	1.3 %
Total	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %

* 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	16 al 20 de julio				23 al 27 de julio				30 de jul. al 3 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	142	6011	6171	25	116	3864	4467	12	141	3167	3358
Intragrupa y off-shore***	0	0	2871	1985	0	0	1966	1082	0	0	1171	876
Otros	142	24	1194	1919	116	25	1069	1350	141	12	1393	1496
Total	166	166	10076	10076	141	141	6899	6899	153	153	5730	5730

* 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.