

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2018

Fecha de Información: 17 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\$2093.9 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	414.3	219.0	104.0	313.0	55.0	41.3	60.0
15-35	519.3	691.3	358.5	100.0	78.8	165.3	254.0
36-60	252.8	255.6	0.0	0.0	215.6	212.8	40.0
61-90	11.6	12.6	0.0	0.0	2.6	1.6	10.0
91-180	0.0	11.5	0.0	0.0	11.5	0.0	0.0
>180	25.0	69.9	40.0	0.0	4.9	0.0	25.0
Total	1223.0	1259.9	502.5	413.0	368.4	421.0	389.0

* 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	2.3 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.3 %	0.9 %	2.3 %
>180	2.0 %	2.0 %	-	2.0 %
Total	2.1 %	2.1 %	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

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	6232	6235	26	116	4027	4604	12	141	3238	3412
Intragrupa y off-shore***	0	0	2881	2179	0	0	2060	1201	0	0	1182	876
Otros	142	24	1222	1921	116	26	1092	1374	141	12	1395	1527
Total	166	166	10335	10335	142	142	7179	7179	153	153	5815	5815

* 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.