

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2018

Fecha de Información: 19 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\$2381.1 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	282.3	242.7	157.6	193.0	15.6	19.8	69.5
15-35	524.5	838.7	657.0	206.0	6.7	143.5	175.0
36-60	214.4	172.8	0.0	0.0	137.8	179.4	35.0
61-90	21.8	128.2	120.0	20.0	8.2	1.8	0.0
91-180	209.2	10.6	0.0	200.0	4.6	3.2	6.0
>180	17.0	4.5	0.0	16.0	4.5	1.0	0.0
Total	1269.2	1397.4	934.6	635.0	177.3	348.7	285.5

* 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	2.2 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.9 %	2.0 %	2.0 %
>180	-	2.5 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.1 %	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	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	143	6364	6344	28	125	4394	4888	12	142	3303	3647
Intragrupa y off-shore***	0	0	2929	2259	0	0	2194	1450	0	0	1349	876
Otros	142	24	1223	1913	125	28	1158	1410	142	12	1410	1539
Total	166	166	10515	10515	153	153	7747	7747	154	154	6063	6063

* 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.