

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1617.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	269.3	358.0	202.5	111.0	69.0	71.8	86.5
15-35	421.9	397.5	241.0	116.0	18.5	167.9	138.0
36-60	132.3	72.7	0.0	37.0	71.7	94.3	1.0
61-90	9.0	33.7	0.0	0.0	33.7	9.0	0.0
91-180	93.3	75.7	0.0	40.0	45.7	23.3	30.0
>180	5.0	4.2	0.0	0.0	4.2	5.0	0.0
Total	930.9	941.8	443.5	304.0	242.8	371.4	255.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	2.4 %	1.8 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	6.0 %	1.7 %	5.1 %
91-180	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
>180	-	2.4 %	1.4 %	1.9 %
Total	2.2 %	2.5 %	2.0 %	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	23 al 27 de julio				30 de jul. al 3 de agosto				6 al 10 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	129	4550	5056	16	143	3377	3790	10	92	5000	5400
Intragruppo y off-shore***	0	0	2308	1542	0	0	1438	894	0	0	1633	874
Otros	129	31	1168	1428	143	16	1422	1553	92	10	2455	2814
Total	160	160	8026	8026	159	159	6237	6237	102	102	9088	9088

* 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 intragruppo.