

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2018

Fecha de Información: 25 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\$1971.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	414.1	310.0	137.2	238.5	17.8	20.6	155.0
15-35	487.0	521.2	259.5	233.5	115.7	107.6	146.0
36-60	273.3	189.4	0.0	0.0	189.4	273.3	0.0
61-90	24.6	24.2	0.0	0.0	4.2	4.6	20.0
91-180	30.1	21.1	0.0	20.0	11.1	0.1	10.0
>180	1.2	6.5	0.0	0.0	6.5	1.2	0.0
Total	1230.3	1072.3	396.7	492.0	344.6	407.4	331.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	1.6 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.1 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
>180	-	2.3 %	1.9 %	2.2 %
Total	2.3 %	2.2 %	1.9 %	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	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**	37	134	5000	5229	17	146	3637	3909	10	95	5168	5674
Intragruppo y off-shore***	0	0	2414	1920	0	0	1458	1060	0	0	1770	879
Otros	134	37	1159	1424	146	17	1432	1558	95	10	2466	2853
Total	171	171	8573	8573	162	162	6527	6527	106	106	9405	9405

* 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 intragruppo.