

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1546.7 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	210.3	190.3	86.3	103.3	33.0	36.0	71.0
15-35	404.4	314.3	166.1	220.3	19.7	55.6	128.5
36-60	254.7	226.2	0.0	0.0	191.2	219.7	35.0
61-90	44.3	114.4	70.0	0.0	4.4	4.3	40.0
91-180	10.1	31.8	0.0	0.0	21.8	0.1	10.0
>180	17.7	12.6	10.0	0.0	2.6	17.7	0.0
Total	941.5	889.6	332.4	323.6	272.7	333.4	284.5

* 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 %	2.4 %	1.4 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.0 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.1 %	2.1 %	1.8 %	2.1 %
91-180	1.9 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
Total	2.1 %	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	5046	5268	18	146	3777	3981	10	98	5191	5755
Intragrupa y off-shore***	0	0	2428	1941	0	0	1464	1125	0	0	1841	896
Otros	134	37	1158	1424	146	18	1452	1588	98	10	2477	2858
Total	170	170	8633	8633	164	164	6693	6693	108	108	9509	9509

* 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.