Fecha de Publicación: 14 de junio de 2018

Fecha de Información: 12 de junio 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$1618.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	345.6	432.5	313.0	215.5	78.5	89.1	41.0
15-35	194.2	314.3	218.0	78.5	26.3	45.7	70.0
36-60	198.0	105.5	0.0	10.0	80.5	163.0	25.0
61-90	23.2	29.6	14.0	0.0	15.6	23.2	0.0
91-180	53.5	41.3	0.0	10.0	41.3	43.5	0.0
>180	10.2	6.2	0.0	0.0	6.2	10.2	0.0
Total	**824.8**	**929.3**	**545.0**	**314.0**	**248.3**	**374.8**	**136.0**

* 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	1.2 %	1.1 %	1.2 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %
36-60	1.3 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	1.7 %	1.1 %	1.4 %
91-180	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
>180	-	1.4 %	1.6 %	1.5 %
Total	1.2 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %

*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

Sectores	11 al 15 de junio				18 al 22 de junio				25 al 29 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	60	146	4676	4906	51	117	5095	5018	9	162	2893	3579
Intragrupo y off-shore***	0	0	1699	1107	0	0	1969	1611	0	0	1648	955
Otros	136	50	1602	1964	107	41	1574	2009	162	9	1058	1066
Total	**196**	**196**	**7977**	**7977**	**158**	**158**	**8638**	**8638**	**171**	**171**	**5599**	**5599**

* 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.