Fecha de Publicación: 15 de junio de 2018

Fecha de Información: 13 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$2038.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[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	368.4	215.6	121.0	196.0	25.6	103.4	69.0
15-35	414.4	560.1	314.2	72.4	91.1	187.2	154.8
36-60	221.0	309.8	37.0	0.0	222.8	171.0	50.0
61-90	11.6	19.2	0.0	0.0	19.2	11.6	0.0
91-180	61.2	72.5	27.5	45.0	29.9	1.2	15.0
>180	11.5	62.2	20.0	8.0	42.2	3.5	0.0
Total	**1088.0**	**1239.4**	**519.7**	**321.4**	**430.9**	**477.8**	**288.8**

* 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	1.9 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.2 %
61-90	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	-	1.9 %	2.0 %	1.9 %
Total	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %

*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**	52	135	4883	4976	42	106	5252	5163	8	165	2944	3628
Intragrupo y off-shore***	0	0	1704	1234	0	0	2065	1665	0	0	1671	970
Otros	135	52	1613	1989	106	42	1589	2078	164	8	1058	1077
Total	**187**	**187**	**8199**	**8199**	**148**	**148**	**8906**	**8906**	**173**	**173**	**5674**	**5674**

* 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.