Fecha de Publicación: 20 de junio de 2018

Fecha de Información: 18 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$2113.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.[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	468.1	349.0	214.8	335.8	27.8	25.9	106.5
15-35	297.1	778.1	537.0	29.5	58.1	84.6	183.0
36-60	193.9	190.9	30.0	0.0	130.9	163.9	30.0
61-90	9.2	8.2	0.0	0.0	8.2	9.2	0.0
91-180	66.3	43.6	10.0	0.0	33.6	66.3	0.0
>180	22.7	5.6	0.0	0.0	5.6	22.7	0.0
Total	**1057.4**	**1375.5**	**791.7**	**365.3**	**264.3**	**372.7**	**319.5**

* 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	2.0 %	1.8 %	2.1 %	2.0 %
15-35	1.7 %	1.6 %	1.1 %	1.6 %
36-60	1.7 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
61-90	-	1.7 %	1.0 %	1.4 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.5 %
>180	-	2.2 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %

*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	18 al 22 de junio				25 al 29 de junio				2 al 6 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	121	6048	5763	11	175	3075	3846	20	71	1629	1484
Intragrupo y off-shore***	0	0	2369	2148	0	0	1783	987	0	0	658	472
Otros	121	38	1660	2166	175	11	1108	1134	71	20	331	661
Total	**159**	**159**	**10077**	**10077**	**186**	**186**	**5967**	**5967**	**91**	**91**	**2617**	**2617**

* 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.