Fecha de Publicación: 25 de junio de 2018

Fecha de Información: 21 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$1970.0 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	221.8	299.5	217.5	127.0	41.0	53.8	41.0
15-35	178.9	286.5	211.0	72.8	16.5	47.2	59.0
36-60	411.0	464.0	8.9	0.0	455.2	411.0	0.0
61-90	67.4	46.4	0.0	15.0	16.4	22.4	30.0
91-180	37.5	3.8	0.0	10.0	3.8	27.5	0.0
>180	75.2	8.1	4.5	53.6	3.6	21.6	0.0
Total	**991.8**	**1108.2**	**441.9**	**278.3**	**536.4**	**583.5**	**130.0**

* 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	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	1.7 %	2.4 %	1.6 %	1.8 %
91-180	-	2.0 %	1.5 %	1.6 %
>180	-	2.0 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.7 %	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**	36	136	6280	6206	14	169	3296	4029	28	72	1712	1639
Intragrupo y off-shore***	0	0	2716	2328	0	0	1884	1114	0	0	731	477
Otros	136	36	1717	2180	169	14	1166	1204	72	28	349	676
Total	**171**	**171**	**10713**	**10713**	**183**	**183**	**6346**	**6346**	**100**	**100**	**2792**	**2792**

* 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.