Fecha de Publicación: 26 de junio de 2018

Fecha de Información: 22 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$1719.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.[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	266.7	360.9	255.0	155.3	17.4	22.8	88.5
15-35	598.5	452.3	169.5	309.7	70.3	76.3	212.5
36-60	67.7	36.0	0.0	0.0	36.0	67.7	0.0
61-90	35.7	25.1	7.8	20.0	7.3	5.7	10.0
91-180	20.3	78.1	53.6	20.0	24.5	0.3	0.0
>180	57.7	67.5	30.0	20.0	1.5	1.7	36.0
Total	**1046.5**	**1019.9**	**515.9**	**525.0**	**157.0**	**174.5**	**347.0**

* 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	1.8 %	1.3 %	1.7 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.0 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.7 %	2.3 %	1.5 %	1.9 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	2.0 %
>180	1.9 %	1.5 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.6 %	1.6 %	1.6 %

*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	16	179	3513	4342	28	73	1760	1675
Intragrupo y off-shore***	0	0	2716	2328	0	0	2139	1259	0	0	731	487
Otros	136	36	1718	2180	179	16	1170	1222	73	28	350	679
Total	**172**	**172**	**10713**	**10713**	**195**	**195**	**6822**	**6822**	**101**	**101**	**2841**	**2841**

* 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.