Fecha de Publicación: 27 de junio de 2018

Fecha de Información: 25 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$2084.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.[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	202.5	244.9	118.0	63.0	7.9	20.5	119.0
15-35	702.1	640.8	292.8	232.8	96.5	217.8	251.5
36-60	192.7	215.1	0.0	10.0	200.1	167.7	15.0
61-90	0.5	3.6	0.0	0.0	3.6	0.5	0.0
91-180	113.0	60.7	10.0	63.0	20.7	20.0	30.0
>180	88.0	50.8	35.0	60.0	0.8	13.0	15.0
Total	**1298.9**	**1216.0**	**455.8**	**428.8**	**329.7**	**439.6**	**430.5**

* 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	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	2.1 %	1.1 %	2.0 %
91-180	1.7 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

[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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de junio				2 al 6 de julio				9 al 13 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	179	3630	4507	30	73	1785	1699	12	118	3474	3466
Intragrupo y off-shore***	0	0	2255	1322	0	0	733	487	0	0	1286	903
Otros	179	17	1177	1233	73	30	350	682	118	12	1020	1412
Total	**196**	**196**	**7062**	**7062**	**103**	**103**	**2868**	**2868**	**130**	**130**	**5781**	**5781**

* 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.