Fecha de Publicación: 4 de julio de 2018

Fecha de Información: 29 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$1436.8 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	240.2	219.2	111.0	129.5	26.2	28.7	82.0
15-35	377.8	568.4	386.0	247.1	94.9	43.3	87.5
36-60	33.4	18.0	1.2	0.0	16.8	33.4	0.0
61-90	1.0	16.3	0.0	0.0	16.3	1.0	0.0
91-180	1.6	41.7	10.0	0.0	31.7	1.6	0.0
>180	26.7	77.0	50.0	10.0	12.0	1.7	15.0
Total	**680.8**	**940.5**	**558.1**	**386.6**	**197.9**	**109.7**	**184.5**

* 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	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.1 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	1.5 %	2.2 %
>180	2.0 %	2.0 %	1.7 %	2.0 %
Total	1.8 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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	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	178	4494	4722	37	79	2187	2214	17	119	3636	3684
Intragrupo y off-shore***	0	0	2302	1973	0	0	1009	632	0	0	1387	933
Otros	178	17	1154	1254	79	37	370	721	119	17	1069	1475
Total	**195**	**195**	**7950**	**7950**	**115**	**115**	**3566**	**3566**	**136**	**136**	**6092**	**6092**

* 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.