

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2018

Fecha de Información: 30 de julio 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\$1496.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	282.7	162.9	8.5	109.0	10.4	29.7	144.0
15-35	281.3	405.9	200.2	124.5	126.2	77.3	79.5
36-60	240.7	190.6	1.6	0.0	184.0	235.7	5.0
61-90	0.1	8.3	0.0	0.0	8.3	0.1	0.0
91-180	63.8	41.1	0.0	0.0	36.1	58.8	5.0
>180	20.0	52.2	0.0	0.0	32.2	0.0	20.0
Total	888.6	861.0	210.3	233.5	397.3	401.6	253.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.2 %	1.1 %	1.6 %
15-35	2.0 %	2.2 %	1.8 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.3 %	2.1 %	2.3 %
91-180	1.8 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.1 %	-	2.0 %
Total	2.0 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %

*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	30 de jul. al 3 de agosto				6 al 10 de agosto				13 al 17 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	148	4207	4212	10	102	5287	5849	17	135	3725	4053
Intragruppo y off-shore***	0	0	1522	1362	0	0	1860	905	0	0	1645	849
Otros	148	24	1499	1654	102	10	2484	2878	135	17	1283	1752
Total	172	172	7229	7229	112	112	9631	9631	152	152	6653	6653

* 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 intragruppo.