

Fecha de Publicación: 3 de agosto de 2018

Fecha de Información: 01 de agosto 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\$2095.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	479.1	358.8	63.0	236.0	62.8	10.1	233.0
15-35	509.3	723.5	457.4	158.5	64.2	148.8	202.0
36-60	186.0	173.8	1.1	16.1	105.7	102.8	67.0
61-90	103.9	32.0	0.0	0.0	32.0	103.9	0.0
91-180	9.6	12.8	0.0	0.0	12.8	9.6	0.0
>180	6.2	7.6	0.0	0.0	2.6	1.2	5.0
Total	1294.0	1308.6	521.5	410.6	280.1	376.4	507.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.3 %	1.7 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.5 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.6 %
>180	1.8 %	2.2 %	1.6 %	1.9 %
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	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	149	4591	4449	11	105	5744	6240	17	138	3940	4231
Intragruppo y off-shore***	0	0	1620	1598	0	0	2002	1146	0	0	1672	904
Otros	149	24	1498	1663	105	11	2597	2956	138	17	1330	1806
Total	173	173	7710	7710	117	117	10342	10342	156	156	6942	6942

* 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.