

Fecha de Publicación: 8 de agosto de 2018

Fecha de Información: 03 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\$974.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65.6	66.0	41.0	49.0	25.0	16.6	0.0
15-35	324.3	385.7	211.7	88.0	5.0	67.3	169.0
36-60	199.6	36.6	0.0	0.0	2.6	165.6	34.0
61-90	22.7	1.0	0.0	20.0	1.0	2.7	0.0
91-180	20.5	32.7	0.0	0.0	12.7	0.5	20.0
>180	35.2	7.5	0.0	35.0	7.5	0.2	0.0
Total	667.9	529.4	252.7	192.0	53.7	252.9	223.0

* 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 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
36-60	1.9 %	2.2 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	2.4 %	1.6 %	1.8 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.3 %	2.0 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.9 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	23	148	4628	4546	15	104	6094	6514	17	133	3997	4320
Intragrupa y off-shore***	0	0	1695	1611	0	0	2057	1302	0	0	1726	914
Otros	148	23	1497	1664	104	15	2640	2975	133	17	1355	1844
Total	171	171	7821	7821	120	120	10791	10791	151	151	7078	7078

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.