

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2018

Fecha de Información: 09 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\$1671.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	157.8	184.7	112.5	98.5	40.2	27.3	32.0
15-35	461.8	682.0	421.0	107.0	47.0	140.8	214.0
36-60	143.6	140.1	0.0	0.0	140.1	143.6	0.0
61-90	67.4	14.3	0.0	20.0	14.3	47.4	0.0
91-180	9.3	9.7	0.0	0.0	9.7	9.3	0.0
>180	46.2	10.3	0.0	18.5	0.3	17.7	10.0
Total	886.2	1041.2	533.5	244.0	251.7	386.2	256.0

* 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	2.9 %	2.4 %	1.8 %	2.2 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	3.9 %	1.8 %	2.3 %
91-180	-	2.4 %	1.5 %	2.0 %
>180	2.0 %	1.6 %	0.4 %	0.9 %
Total	2.3 %	2.2 %	1.8 %	2.1 %

*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	6 al 10 de agosto				13 al 17 de agosto				20 al 24 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	107	6561	6713	23	137	4225	4530	38	106	3447	3738
Intragrupa y off-shore***	0	0	2116	1640	3	0	1810	1007	0	0	1625	1010
Otros	107	15	2692	3018	135	23	1412	1909	106	38	988	1312
Total	122	122	11370	11370	161	161	7446	7446	143	143	6060	6060

* 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.