

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2018

Fecha de Información: 10 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\$2286.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	279.0	393.1	209.4	50.0	26.3	71.6	157.4
15-35	578.9	1008.8	586.1	78.0	150.7	228.9	272.0
36-60	52.8	47.4	0.0	0.0	47.4	52.8	0.0
61-90	87.9	78.5	0.0	0.0	58.5	67.9	20.0
91-180	67.5	8.2	0.0	0.0	8.2	67.5	0.0
>180	80.0	93.3	50.0	12.7	3.3	27.3	40.0
Total	1146.1	1629.3	845.5	140.7	294.4	516.0	489.4

* 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	2.2 %	3.2 %	1.9 %	2.3 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
36-60	-	2.5 %	1.9 %	2.2 %
61-90	2.1 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %
91-180	-	2.5 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.8 %	2.1 %	1.3 %	1.7 %
Total	2.2 %	2.4 %	1.9 %	2.2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	24	143	4404	4671	41	105	3542	3990
Intragruppo y off-shore***	0	0	2116	1640	3	0	1848	1057	0	0	1795	1010
Otros	107	15	2693	3018	140	24	1438	1963	105	41	989	1326
Total	122	122	11370	11370	168	168	7691	7691	146	146	6326	6326

* 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.