

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2018

Fecha de Información: 13 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\$2718.6 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	131.1	176.2	112.7	10.0	5.5	63.1	58.0
15-35	625.1	1160.6	950.9	110.2	47.6	352.9	162.0
36-60	235.7	163.9	0.0	2.5	163.9	233.2	0.0
61-90	49.8	0.5	0.0	0.0	0.5	49.8	0.0
91-180	118.4	29.3	0.0	22.3	24.3	91.1	5.0
>180	176.0	96.3	61.6	22.7	15.5	134.0	19.2
Total	1336.0	1626.7	1125.2	167.7	257.3	924.1	244.2

* 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	2.4 %	2.2 %	1.5 %	2.0 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.1 %	2.4 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.3 %	1.6 %	1.7 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
Total	2.4 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	13 al 17 de agosto				20 al 24 de agosto				27 al 31 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	148	4464	4763	46	105	3602	4027	5	171	3069	3769
Intragruppo y off-shore***	3	0	1904	1067	0	0	1809	1010	0	0	1972	988
Otros	145	25	1437	1974	105	46	992	1366	171	5	1018	1302
Total	173	173	7804	7804	151	151	6402	6402	177	177	6058	6058

* 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 intragrupo.