

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2018

Fecha de Información: 14 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\$2312.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	440.5	290.6	167.8	282.5	49.1	84.3	73.7
15-35	516.8	851.2	567.5	196.3	75.4	112.1	208.4
36-60	146.0	152.4	0.0	0.0	152.4	146.0	0.0
61-90	9.3	0.9	0.0	0.0	0.9	9.3	0.0
91-180	57.3	19.9	10.0	0.0	3.6	51.1	6.2
>180	108.2	13.2	7.1	20.0	0.8	82.8	5.4
Total	1278.1	1328.3	752.4	498.8	282.2	485.7	293.7

* 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	2.4 %	2.4 %	0.9 %	1.5 %
15-35	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	6.0 %	1.7 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.9 %	1.5 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.3 %	1.4 %
Total	2.3 %	2.4 %	1.6 %	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

Sectores	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	151	4752	4861	47	105	3745	4170	5	172	3090	3837
Intragruppo y off-shore***	3	0	1938	1291	0	0	1891	1069	0	0	2022	988
Otros	149	25	1442	1982	105	47	1036	1434	172	5	1035	1323
Total	177	177	8133	8133	152	152	6673	6673	177	177	6148	6148

* 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 intragruppo.