

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2018

Fecha de Información: 15 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\$3235.7 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	583.7	292.0	48.5	334.8	30.2	35.7	213.3
15-35	516.5	1077.0	823.5	135.0	110.0	238.0	143.5
36-60	328.7	294.9	50.0	95.0	234.9	223.7	10.0
61-90	18.4	4.0	0.0	0.0	4.0	18.4	0.0
91-180	105.7	201.8	155.3	0.0	6.5	65.7	40.0
>180	197.2	58.6	15.8	89.8	6.8	71.2	36.1
Total	1750.3	1928.3	1093.0	654.6	392.5	652.8	442.9

* 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	2.3 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.4 %	1.8 %	1.9 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
Total	2.2 %	2.3 %	2.0 %	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**	26	152	5249	5058	52	107	3823	4253	7	171	3163	3902
Intragruppo y off-shore***	3	0	1972	1621	0	0	1906	1074	0	0	2037	997
Otros	150	26	1442	1984	107	52	1055	1458	171	7	1048	1349
Total	178	178	8663	8663	159	159	6785	6785	178	178	6248	6248

* 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.