

Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2018

Fecha de Información: 16 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\$3372.7 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	395.0	237.0	138.7	280.6	18.3	34.5	80.0
15-35	1088.0	956.5	471.5	403.0	340.5	540.5	144.5
36-60	170.2	130.9	2.1	14.5	128.9	155.8	0.0
61-90	26.7	69.3	50.0	0.0	9.3	16.7	10.0
91-180	111.9	248.5	215.0	50.0	23.5	51.9	10.0
>180	144.2	108.5	30.0	29.0	8.8	45.5	69.7
Total	1936.1	1750.8	907.3	777.0	529.4	844.8	314.2

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	2.1 %	2.4 %	1.4 %	2.1 %
91-180	2.1 %	2.1 %	1.9 %	2.1 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.3 %	2.1 %	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**	28	153	5410	5081	50	108	4037	4359	8	171	3221	4018
Intragruppo y off-shore***	3	0	1991	1739	0	0	1955	1215	0	0	2113	1018
Otros	151	28	1446	2027	108	50	1061	1480	171	8	1057	1356
Total	181	181	8847	8847	158	158	7054	7054	179	179	6391	6391

* 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.