

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2018

Fecha de Información: 17 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\$1632.7 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	233.2	265.9	127.0	116.0	51.9	30.2	87.0
15-35	511.4	406.5	254.0	165.0	80.5	274.4	72.0
36-60	152.5	24.8	0.0	0.0	24.8	152.5	0.0
61-90	11.6	36.2	25.0	0.0	4.2	4.6	7.0
91-180	13.0	35.0	10.0	0.0	20.0	8.0	5.0
>180	87.9	25.5	15.0	0.0	10.5	87.9	0.0
Total	1009.7	793.9	431.0	281.0	191.9	557.7	171.0

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

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	154	5409	5081	51	117	4194	4527	8	168	3293	4107
Intragruppo y off-shore***	3	0	1991	1739	0	0	2047	1317	0	0	2145	1032
Otros	151	28	1447	2026	117	51	1083	1480	168	8	1082	1382
Total	182	182	8847	8847	167	167	7325	7325	176	176	6520	6520

* 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.