

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2018

Fecha de Información: 24 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\$1238.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	195.8	230.7	110.4	143.4	85.0	17.1	35.3
15-35	408.2	318.2	183.6	226.8	31.3	78.1	103.3
36-60	60.3	66.5	0.0	0.0	66.5	60.3	0.0
61-90	1.9	10.1	0.0	0.0	10.1	1.9	0.0
91-180	14.0	54.9	0.0	4.6	46.9	1.4	8.0
>180	12.3	12.5	0.0	9.5	12.5	2.8	0.0
Total	692.4	692.9	294.0	384.2	252.3	161.6	146.6

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

*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	20 al 24 de agosto				27 al 31 de agosto				3 al 7 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	116	4802	4784	14	180	3986	4634	21	99	3191	3661
Intragruppo y off-shore***	0	0	2195	1861	0	0	2347	1493	0	0	1403	427
Otros	116	45	1138	1490	180	14	1305	1511	99	21	1331	1836
Total	161	161	8136	8136	194	194	7637	7637	120	120	5924	5924

* 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 intragruppo.