

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2018

Fecha de Información: 27 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\$1151.8 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	226.0	180.4	45.0	128.4	47.4	9.6	88.0
15-35	347.1	270.5	166.6	157.5	47.9	133.6	56.0
36-60	114.7	81.5	0.4	0.0	81.1	114.7	0.0
61-90	5.6	9.1	0.0	0.0	9.1	5.6	0.0
91-180	11.0	34.8	0.0	0.0	32.8	9.0	2.0
>180	13.0	17.1	0.0	0.0	4.1	0.0	13.0
Total	717.4	593.4	212.0	285.9	222.4	272.6	159.0

* 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	2.0 %	2.8 %	1.8 %	2.1 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.8 %	1.7 %	2.3 %
91-180	1.8 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.1 %	2.4 %	-	2.2 %
Total	2.0 %	2.2 %	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

Sector	27 al 31 de agosto				3 al 7 de septiembre				10 al 14 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	184	4190	4759	22	100	3200	3677	12	103	5131	6241
Intragruppo y off-shore***	0	0	2392	1616	0	0	1402	427	0	0	3283	900
Otros	184	14	1311	1518	100	22	1342	1840	103	12	1535	2808
Total	198	198	7893	7893	121	121	5944	5944	115	115	9949	9949

* 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.