

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2018

Fecha de Información: 28 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\$2389.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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 | 472.5 | 321.9 | 144.0 | 248.4 | 29.4 | 75.6 | 148.5 |
| 15-35 | 607.3 | 722.6 | 455.3 | 137.5 | 14.3 | 216.8 | 253.0 |
| 36-60 | 336.8 | 176.0 | 0.0 | 25.0 | 176.0 | 311.8 | 0.0 |
| 61-90 | 20.1 | 3.4 | 0.0 | 0.0 | 3.4 | 20.1 | 0.0 |
| 91-180 | 13.8 | 14.3 | 0.0 | 0.0 | 14.3 | 13.8 | 0.0 |
| >180 | 28.6 | 84.1 | 71.2 | 0.0 | 2.9 | 18.6 | 10.0 |
| Total | 1479.0 | 1322.3 | 670.5 | 410.9 | 240.3 | 656.7 | 411.5 |

* 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 % | 1.9 % | 1.4 % | 1.6 % |
| 15-35 | 1.9 % | 2.0 % | 1.8 % | 1.9 % |
| 36-60 | - | 1.8 % | 1.7 % | 1.8 % |
| 61-90 | - | 2.2 % | 1.5 % | 1.6 % |
| 91-180 | - | 2.2 % | 1.2 % | 1.7 % |
| >180 | 1.9 % | 1.9 % | 1.2 % | 1.8 % |
| Total | 1.9 % | 2.0 % | 1.6 % | 1.8 % |

*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 | 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 | 175 | 4424 | 4848 | 28 | 100 | 3357 | 3876 | 13 | 102 | 5256 | 6329 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2446 | 1790 | 0 | 0 | 1487 | 457 | 0 | 0 | 3323 | 945 |
| Otros | 175 | 14 | 1315 | 1547 | 100 | 28 | 1361 | 1872 | 102 | 13 | 1538 | 2843 |
| Total | 189 | 189 | 8185 | 8185 | 127 | 127 | 6205 | 6205 | 116 | 116 | 10117 | 10117 |

* 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.