

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2018

Fecha de Información: 29 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\$2316.0 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	510.7	412.9	246.0	315.4	34.9	63.3	132.0
15-35	288.8	635.2	422.9	86.0	85.8	76.3	126.5
36-60	314.5	189.9	0.0	0.0	189.9	314.5	0.0
61-90	22.3	3.8	0.0	20.0	3.8	2.3	0.0
91-180	125.5	6.4	0.0	101.0	6.4	24.5	0.0
>180	51.7	12.7	10.0	13.7	2.7	38.0	0.0
Total	1313.6	1260.9	678.9	536.1	323.5	519.0	258.5

* 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	2.6 %	2.0 %	1.5 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	2.4 %	1.7 %	1.7 %
Total	2.3 %	1.9 %	1.7 %	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

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**	15	177	4763	4960	37	100	3479	4142	22	103	5290	6364
Intragruppo y off-shore***	0	0	2486	2071	0	0	1668	477	0	0	3348	962
Otros	177	15	1334	1553	100	37	1365	1893	103	22	1548	2860
Total	192	192	8584	8584	137	137	6512	6512	125	125	10186	10186

* 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.