

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 30 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\$2487.9 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	432.9	299.4	110.0	232.0	90.9	102.4	98.5
15-35	483.1	834.6	576.5	91.0	66.6	200.5	191.6
36-60	335.9	180.2	0.0	0.0	180.2	335.9	0.0
61-90	6.8	18.3	0.0	0.0	18.3	6.8	0.0
91-180	100.8	83.9	20.0	0.0	7.9	44.8	56.0
>180	37.0	21.1	20.0	8.0	1.1	29.0	0.0
Total	1396.4	1437.5	726.5	331.0	365.0	719.3	346.1

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

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**	15	177	4851	4977	39	105	3681	4298	24	105	5432	6486
Intragruppo y off-shore***	0	0	2496	2156	0	0	1713	564	0	0	3403	1022
Otros	177	15	1341	1556	105	39	1408	1940	105	24	1585	2912
Total	192	192	8688	8688	145	145	6802	6802	128	128	10420	10420

* 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.