

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 31 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\$2025.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	395.0	204.1	105.8	270.3	42.3	68.7	56.0
15-35	321.1	944.8	739.0	61.0	73.8	128.1	132.0
36-60	51.3	34.6	0.0	0.0	34.6	51.3	0.0
61-90	46.3	27.6	20.0	0.0	7.6	46.3	0.0
91-180	100.6	7.8	0.0	0.0	7.8	100.6	0.0
>180	58.1	36.9	19.3	5.6	2.4	37.3	15.2
Total	972.5	1255.7	884.1	336.9	168.4	432.4	203.2

* 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	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.8 %	2.0 %	-1.1 %	1.4 %
36-60	-	2.0 %	1.6 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.6 %	1.8 %
91-180	-	2.2 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.5 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.8 %	2.0 %	1.1 %	1.6 %

*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	150	4851	5005	43	107	3954	4362	30	107	5546	6628
Intragruppo y off-shore***	0	0	2496	2156	0	0	1742	790	0	0	3480	1066
Otros	150	15	1369	1556	107	43	1420	1964	107	30	1617	2948
Total	164	164	8716	8716	150	150	7116	7116	137	137	10642	10642

* 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.