

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 03 de septiembre 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\$269.4 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	65.4	38.4	7.0	22.0	9.4	21.4	22.0
15-35	47.3	102.1	59.0	4.0	6.1	6.3	37.0
36-60	32.7	40.5	20.0	0.4	0.5	12.4	20.0
61-90	0.3	6.8	0.0	0.0	6.8	0.3	0.0
91-180	0.4	2.8	0.0	0.0	2.8	0.4	0.0
>180	11.7	5.2	0.0	5.1	0.1	1.5	5.1
Total	157.7	195.7	86.0	31.5	25.6	42.1	84.1

* 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	1.8 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.5 %	1.9 %
36-60	1.9 %	2.0 %	1.5 %	1.9 %
61-90	-	1.9 %	0.6 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.2 %	1.9 %
>180	1.9 %	3.1 %	1.1 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.9 %	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	3 al 7 de septiembre				10 al 14 de septiembre				17 al 21 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	110	3998	4391	32	107	5564	6635	70	127	4009	3967
Intragruppo y off-shore***	0	0	1742	812	0	0	3487	1066	0	0	1757	1274
Otros	110	44	1428	1965	107	32	1616	2967	127	70	1381	1905
Total	154	154	7168	7168	139	139	10668	10668	197	197	7147	7147

* 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.