

Fecha de Publicación: 7 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 05 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\$2057.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	344.4	109.4	51.0	298.3	42.4	30.1	16.0
15-35	383.9	773.5	541.7	113.6	99.8	138.3	132.0
36-60	79.6	3.0	0.0	0.0	3.0	79.6	0.0
61-90	26.3	21.9	0.0	10.1	21.9	16.2	0.0
91-180	209.8	207.3	50.0	0.0	142.1	194.6	15.2
>180	58.8	42.9	0.0	0.0	2.7	18.6	40.2
Total	1102.8	1157.9	642.7	422.0	311.8	477.4	203.4

* 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	1.2 %	2.1 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.9 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	2.3 %	1.4 %	1.8 %
91-180	1.8 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.8 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
Total	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %

*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	108	4324	4511	37	109	5965	6782	72	128	4159	4194
Intragruppo y off-shore***	0	0	1801	1082	0	0	3560	1384	0	0	1857	1286
Otros	108	44	1446	1979	109	37	1640	2998	128	72	1408	1943
Total	151	151	7571	7571	146	146	11165	11165	200	200	7424	7424

* 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.