

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 07 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\$1661.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	457.3	425.6	216.5	219.0	49.1	78.3	160.0
15-35	415.1	461.9	194.3	121.8	26.6	52.4	241.0
36-60	29.9	37.5	0.0	0.0	37.5	29.9	0.0
61-90	5.4	24.5	0.0	3.0	24.5	2.4	0.0
91-180	142.1	156.1	29.0	30.0	22.1	7.1	105.0
>180	8.2	4.0	0.0	0.0	4.0	8.2	0.0
Total	1058.2	1109.7	439.8	373.8	163.9	178.4	506.0

* 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 %	1.1 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.7 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.1 %	1.5 %	2.0 %
91-180	1.8 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %

*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**	43	110	4346	4527	40	121	6696	7244	72	130	4520	4677
Intragruppo y off-shore***	0	0	1801	1102	0	0	3818	1910	0	0	2033	1316
Otros	110	43	1462	1980	121	40	1730	3089	130	72	1423	1982
Total	153	153	7609	7609	161	161	12243	12243	201	201	7975	7975

* 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.