

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 11 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\$2540.3 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	546.0	318.8	33.2	314.3	129.6	75.8	156.0
15-35	519.1	509.3	356.8	324.0	95.6	138.1	57.0
36-60	272.7	113.8	0.0	0.0	108.8	267.7	5.0
61-90	12.0	33.0	0.0	0.0	33.0	12.0	0.0
91-180	43.4	141.6	40.0	3.8	101.6	39.6	0.0
>180	37.8	220.8	206.0	20.6	4.8	7.1	10.0
Total	1430.9	1337.4	636.0	662.7	473.4	540.3	228.0

* 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	1.7 %	2.1 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.4 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.7 %	1.9 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.5 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.6 %	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	10 al 14 de septiembre				17 al 21 de septiembre				24 al 28 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	40	124	7564	7671	73	140	4774	4826	25	116	2759	3580
Intragruppo y off-shore***	0	0	3926	2561	0	0	2052	1395	0	0	2049	1007
Otros	124	40	1881	3141	140	73	1447	2051	116	25	844	1065
Total	164	164	13372	13372	214	214	8272	8272	141	141	5652	5652

* 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.