

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 12 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\$2946.0 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	633.4	179.3	99.0	499.0	16.3	70.4	64.0
15-35	480.3	720.0	427.8	80.8	132.2	239.5	160.0
36-60	202.3	162.9	10.0	0.0	92.9	142.3	60.0
61-90	367.8	259.6	0.0	0.0	259.6	367.8	0.0
91-180	33.8	174.6	141.0	0.0	23.6	23.8	10.0
>180	20.3	25.7	0.0	0.0	5.7	0.3	20.0
Total	1737.8	1522.1	677.8	579.8	530.3	844.0	314.0

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

Sector	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**	39	126	7862	7674	73	141	5077	4990	25	116	2802	3599
Intragruppo y off-shore***	0	0	3927	2834	0	0	2145	1616	0	0	2054	1012
Otros	126	39	1880	3161	141	73	1462	2078	116	25	853	1098
Total	165	165	13670	13670	215	215	8684	8684	141	141	5709	5709

* 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.