

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 14 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\$1171.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	216.5	240.6	164.6	119.0	17.0	38.5	59.0
15-35	372.6	352.6	168.0	176.0	31.6	43.6	153.0
36-60	67.2	74.8	0.0	0.0	74.8	67.2	0.0
61-90	0.2	22.2	0.0	0.0	22.2	0.2	0.0
91-180	6.3	28.0	0.1	0.0	27.9	6.3	0.0
>180	0.4	2.3	0.0	0.0	2.3	0.4	0.0
Total	663.2	720.5	332.7	295.0	175.8	156.2	212.0

* 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	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	1.9 %	1.3 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.2 %
Total	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %

*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**	39	124	7911	7767	78	146	5450	5384	26	134	3047	3728
Intragruppo y off-shore***	0	0	3976	2864	0	0	2489	1872	0	0	2057	1132
Otros	124	39	1891	3147	146	78	1479	2161	134	26	938	1182
Total	163	163	13778	13778	224	224	9418	9418	160	160	6043	6043

* 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.