

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 17 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\$1241.4 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 | 179.2 | 282.0 | 121.0 | 37.0 | 48.0 | 29.2 | 113.0 |
| 15-35 | 319.4 | 256.9 | 72.0 | 139.5 | 7.2 | 2.2 | 177.7 |
| 36-60 | 221.2 | 163.5 | 4.3 | 0.0 | 159.2 | 221.2 | 0.0 |
| 61-90 | 22.2 | 15.8 | 0.0 | 14.9 | 15.8 | 7.3 | 0.0 |
| 91-180 | 33.8 | 29.8 | 0.0 | 33.0 | 29.8 | 0.8 | 0.0 |
| >180 | 0.4 | 7.7 | 0.0 | 0.0 | 7.7 | 0.4 | 0.0 |
| Total | 776.3 | 755.8 | 197.3 | 224.4 | 267.8 | 261.1 | 290.7 |

* 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 intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.6 % | 1.9 % | 1.4 % | 1.7 % |
| 15-35 | 1.6 % | 1.6 % | 1.5 % | 1.5 % |
| 36-60 | - | 1.7 % | 1.6 % | 1.6 % |
| 61-90 | - | 1.9 % | 1.6 % | 1.8 % |
| 91-180 | - | 1.9 % | 1.8 % | 1.9 % |
| >180 | - | 2.2 % | 1.7 % | 2.2 % |
| Total | 1.6 % | 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 | 17 al 21 de septiembre | | | | 24 al 28 de septiembre | | | | 1 al 5 de octubre | | | |
|----------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 77 | 145 | 5486 | 5483 | 26 | 138 | 3187 | 3899 | 17 | 103 | 3251 | 4304 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2556 | 1890 | 0 | 0 | 2111 | 1151 | 0 | 0 | 2423 | 712 |
| Otros | 145 | 77 | 1511 | 2179 | 138 | 26 | 942 | 1190 | 103 | 17 | 1035 | 1694 |
| Total | 221 | 221 | 9553 | 9553 | 163 | 163 | 6241 | 6241 | 120 | 120 | 6709 | 6709 |

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.