

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 19 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\$2024.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	334.2	310.9	128.3	177.5	103.7	77.7	79.0
15-35	500.5	527.9	230.8	181.0	74.1	96.5	223.0
36-60	216.2	168.8	36.0	0.0	132.8	216.2	0.0
61-90	98.7	81.2	0.0	25.0	66.2	58.7	15.0
91-180	39.4	5.1	0.0	30.0	5.1	9.4	0.0
>180	43.9	54.9	12.3	2.0	2.6	1.9	40.0
Total	1232.9	1148.8	407.4	415.5	384.4	460.5	357.0

* 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	1.4 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.4 %	1.3 %	1.4 %
61-90	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	2.0 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.8 %
Total	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %

*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	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**	88	145	5781	5874	38	148	3398	4109	24	103	3438	4385
Intragruppo y off-shore***	0	0	2931	2118	0	0	2157	1241	0	0	2426	783
Otros	145	88	1477	2198	148	38	1026	1231	103	24	1063	1759
Total	232	232	10190	10190	186	186	6581	6581	127	127	6928	6928

* 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.