

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 21 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\$1243.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	283.7	145.5	71.0	191.0	21.5	39.7	53.0
15-35	349.3	284.5	237.5	279.0	14.0	37.3	33.0
36-60	45.4	24.5	0.0	0.0	24.5	45.4	0.0
61-90	25.2	18.2	0.1	0.0	18.2	25.2	0.0
91-180	30.7	116.8	95.5	30.0	21.3	0.7	0.0
>180	1.6	4.1	0.1	0.0	4.0	1.6	0.0
Total	735.9	593.7	404.1	500.0	103.5	149.9	86.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.4 %	1.6 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.3 %	1.5 %
91-180	-	1.7 %	1.7 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.7 %	1.7 %
Total	1.4 %	1.6 %	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

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**	88	143	5851	5902	38	146	3812	4303	24	116	3669	4595
Intragrupa y off-shore***	0	0	2941	2192	0	0	2215	1471	0	0	2461	830
Otros	143	88	1480	2178	146	38	1050	1303	116	24	1079	1783
Total	231	231	10273	10273	184	184	7077	7077	140	140	7209	7209

* 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 intragrupo.