

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 25 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\$1729.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	523.1	179.7	64.5	406.5	70.2	71.6	45.0
15-35	261.0	534.2	392.3	51.2	46.9	114.9	95.0
36-60	110.7	82.1	0.0	26.0	82.1	84.7	0.0
61-90	43.2	46.4	0.0	0.0	46.4	43.2	0.0
91-180	17.6	5.0	0.0	0.0	5.0	17.6	0.0
>180	62.4	44.4	0.0	10.0	4.4	12.4	40.0
Total	1018.2	891.8	456.8	493.7	255.0	344.5	180.0

* 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	0.8 %	1.2 %	0.5 %	0.7 %
15-35	0.7 %	1.5 %	0.8 %	1.2 %
36-60	-	1.3 %	1.2 %	1.3 %
61-90	-	1.7 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.0 %	1.4 %	0.8 %	1.1 %

*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	24 al 28 de septiembre				1 al 5 de octubre				8 al 12 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	154	4472	4497	30	118	4060	4769	16	86	4261	4123
Intragruppo y off-shore***	0	0	2291	2005	0	0	2493	1049	0	0	1660	1128
Otros	154	36	1058	1320	118	30	1151	1885	86	16	1341	2011
Total	190	190	7821	7821	148	148	7704	7704	101	101	7262	7262

* 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 intragruppo.