

Fecha de Publicación: 28 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 26 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\$2048.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	381.6	200.7	93.8	241.0	27.0	60.7	79.9
15-35	572.8	524.4	371.5	360.5	76.2	135.6	76.7
36-60	137.8	122.7	0.0	40.0	122.7	97.8	0.0
61-90	62.9	21.3	10.0	41.0	11.3	21.9	0.0
91-180	29.7	19.4	10.0	5.0	9.4	24.7	0.0
>180	20.3	121.1	60.0	5.3	51.1	5.0	10.0
Total	1205.1	1009.5	545.3	692.8	297.7	345.7	166.6

* 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	0.5 %	0.5 %	-0.1 %	0.2 %
15-35	0.4 %	0.6 %	0.3 %	0.5 %
36-60	-	1.7 %	1.0 %	1.4 %
61-90	-	1.5 %	0.9 %	1.0 %
91-180	-	1.7 %	1.2 %	1.3 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
Total	0.5 %	1.0 %	0.4 %	0.6 %

*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	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	155	4517	4552	36	115	4284	4847	22	86	4386	4287
Intragruppo y off-shore***	0	0	2323	2033	0	0	2532	1224	0	0	1768	1186
Otros	155	36	1071	1326	115	36	1155	1900	86	22	1362	2042
Total	192	192	7911	7911	151	151	7971	7971	108	108	7516	7516

* 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.