

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 13 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\$2032.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	441.0	393.3	230.4	287.5	113.7	104.3	49.3
15-35	323.2	264.8	111.3	130.0	35.9	75.6	117.5
36-60	230.3	175.9	0.0	17.4	175.9	212.9	0.0
61-90	173.5	70.7	0.0	30.0	45.7	118.5	25.0
91-180	36.7	113.9	52.2	10.0	36.7	1.7	25.0
>180	1.0	25.3	20.0	0.0	5.3	1.0	0.0
Total	1205.8	1043.9	413.8	474.9	413.2	514.1	216.8

* 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	2.1 %		1.5 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.7 %		2.0 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-		1.9 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.7 %		2.0 %	1.7 %	1.8 %
91-180	1.8 %		1.9 %	1.6 %	1.9 %
>180	-		1.9 %	1.0 %	1.9 %
Total	1.8 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %

*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	10 al 14 de septiembre				17 al 21 de septiembre				24 al 28 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	124	7911	7767	77	144	5323	5188	26	131	2948	3693
Intragrupo y off-shore***	0	0	3976	2864	0	0	2326	1806	0	0	2055	1079
Otros	124	39	1890	3147	144	77	1479	2134	131	26	930	1161
Total	163	163	13778	13778	220	220	9128	9128	157	157	5934	5934

* 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.