

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 17 de septiembre de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1241.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	179.2	282.0	121.0	37.0	48.0	29.2	113.0
15-35	319.4	256.9	72.0	139.5	7.2	2.2	177.7
36-60	221.2	163.5	4.3	0.0	159.2	221.2	0.0
61-90	22.2	15.8	0.0	14.9	15.8	7.3	0.0
91-180	33.8	29.8	0.0	33.0	29.8	0.8	0.0
>180	0.4	7.7	0.0	0.0	7.7	0.4	0.0
Total	776.3	755.8	197.3	224.4	267.8	261.1	290.7

* 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	
3-14	1.6 %	1.9 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.2 %
Total	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %

*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	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**	77	145	5486	5483	26	138	3187	3899	17	103	3251	4304
Intragrupo y off-shore***	0	0	2556	1890	0	0	2111	1151	0	0	2423	712
Otros	145	77	1511	2179	138	26	942	1190	103	17	1035	1694
Total	221	221	9553	9553	163	163	6241	6241	120	120	6709	6709

* 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.