

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2018

Fecha de Información: 01 de octubre 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\$1679.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.5%.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	198.4	201.6	172.0	128.5	0.6	40.9	29.0
15-35	262.8	582.8	369.2	123.3	104.6	30.5	109.0
36-60	90.6	91.2	10.0	15.0	29.2	23.6	52.0
61-90	37.9	4.8	0.0	8.0	4.8	29.9	0.0
91-180	105.9	90.0	40.0	35.1	10.0	30.8	40.0
>180	232.3	71.5	10.0	50.0	1.5	122.3	60.0
Total	927.8	1042.0	601.2	359.8	150.8	278.0	290.0

* 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	
3-14	0.0 %	0.0 %	-0.1 %	0.0 %
15-35	0.3 %	0.3 %	0.0 %	0.2 %
36-60	0.2 %	0.3 %	0.4 %	0.3 %
61-90	-	1.3 %	0.8 %	0.8 %
91-180	1.1 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
>180	1.5 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
Total	0.6 %	0.3 %	0.5 %	0.5 %

*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	1 al 5 de octubre				8 al 12 de octubre				15 al 19 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	106	5119	5286	24	99	4591	4416	24	121	2352	2302
Intragrupo y off-shore***	0	0	2800	1897	0	0	1835	1298	0	0	885	887
Otros	106	37	1190	1925	99	24	1384	2095	121	24	827	875
Total	143	143	9109	9109	123	123	7810	7810	146	146	4064	4064

* 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.