

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2018

Fecha de Información: 02 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\$1749.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.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	294.4	441.3	205.0	17.0	18.3	59.4	218.0
15-35	427.1	653.4	309.5	178.2	172.4	77.4	171.5
36-60	173.3	126.9	0.0	0.0	31.9	78.3	95.0
61-90	5.8	5.9	0.0	0.0	5.9	5.8	0.0
91-180	27.5	1.8	0.0	15.0	1.8	12.5	0.0
>180	14.4	62.6	60.0	0.0	2.6	14.4	0.0
Total	942.4	1291.9	574.5	210.2	232.9	247.7	484.5

* 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	0.7 %	1.0 %	0.1 %	0.7 %
15-35	0.6 %	0.7 %	0.7 %	0.7 %
36-60	0.6 %	1.0 %	0.8 %	0.7 %
61-90	-	1.6 %	0.5 %	1.1 %
91-180	-	1.9 %	1.3 %	1.3 %
>180	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
Total	0.7 %	0.9 %	0.7 %	0.8 %

*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	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**	33	108	5267	5421	33	101	4724	4653	25	122	2577	2558
Intragruppo y off-shore***	0	0	2812	1914	0	0	1968	1298	0	0	1041	987
Otros	108	33	1199	1943	101	33	1389	2130	122	25	826	900
Total	141	141	9278	9278	134	134	8081	8081	147	147	4445	4445

* 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.