

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2018

Fecha de Información: 05 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\$1271.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	230.4	313.7	102.5	31.0	23.2	11.4	188.0
15-35	445.0	336.8	148.8	112.0	54.1	199.0	134.0
36-60	110.6	97.5	0.0	0.0	97.5	110.6	0.0
61-90	5.3	10.9	0.0	0.0	10.9	5.3	0.0
91-180	1.7	9.6	0.0	0.0	9.6	1.7	0.0
>180	20.1	11.5	0.0	0.0	11.5	20.1	0.0
Total	813.1	780.1	251.3	143.0	206.8	348.1	322.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.5 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.2 %	1.8 %
>180	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.7 %	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	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**	34	115	5604	5573	40	111	5109	5218	27	133	2923	2904
Intragruo y off-shore***	0	0	2858	2177	0	0	2229	1376	0	0	1134	1007
Otros	115	34	1217	1929	111	40	1511	2254	133	27	932	1078
Total	149	149	9679	9679	150	150	8848	8848	159	159	4989	4989

* 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 intragruo.