

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2018

Fecha de Información: 08 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\$683.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	234.1	240.3	106.0	115.5	29.3	13.6	105.0
15-35	146.4	218.1	151.0	50.3	2.1	31.2	65.0
36-60	2.2	1.2	0.0	0.0	1.2	2.2	0.0
61-90	1.5	0.3	0.0	0.0	0.3	1.5	0.0
91-180	6.8	0.3	0.0	0.0	0.3	6.8	0.0
>180	1.6	0.3	0.0	0.0	0.3	1.6	0.0
Total	392.6	460.4	257.0	165.8	33.4	56.8	170.0

* 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	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	1.2 %	0.9 %	1.3 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.1 %	-0.3 %	0.5 %
61-90	-	2.0 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	3.5 %	1.5 %	1.6 %
>180	-	2.1 %	1.1 %	1.3 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %

*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	8 al 12 de octubre				15 al 19 de octubre				22 al 26 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	111	5265	5388	27	133	2985	2959	17	121	3177	3397
Intragrupo y off-shore***	0	0	2335	1487	0	0	1134	1012	0	0	1558	1256
Otros	111	41	1539	2264	133	27	932	1079	121	17	1091	1174
Total	153	153	9139	9139	161	161	5050	5050	138	138	5827	5827

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.