

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2018

Fecha de Información: 27 de septiembre 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\$2272.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.3%.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	552.8	175.0	52.2	427.0	22.8	25.8	100.0
15-35	512.2	810.5	531.5	292.5	154.0	94.7	125.0
36-60	83.1	110.6	0.0	0.0	110.6	83.1	0.0
61-90	23.8	82.6	5.0	6.0	72.6	12.8	5.0
91-180	13.2	60.9	20.0	0.0	35.9	8.2	5.0
>180	70.3	71.2	0.0	0.0	12.2	11.3	59.0
Total	1255.3	1310.8	608.7	725.5	408.1	235.8	294.0

* 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	0.0 %	0.4 %	-0.2 %	-0.1 %
15-35	0.1 %	0.3 %	0.0 %	0.2 %
36-60	-	0.4 %	0.2 %	0.3 %
61-90	0.0 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
91-180	0.3 %	1.4 %	0.8 %	1.3 %
>180	1.7 %	1.5 %	2.3 %	1.8 %
Total	0.4 %	0.5 %	0.0 %	0.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	24 al 28 de septiembre				1 al 5 de octubre				8 al 12 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	154	4595	4578	36	115	4708	4952	24	91	4436	4333
Intragruppo y off-shore***	0	0	2336	2101	0	0	2546	1562	0	0	1793	1207
Otros	154	37	1074	1326	115	36	1171	1910	91	24	1368	2056
Total	191	191	8005	8005	151	151	8424	8424	115	115	7597	7597

* 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.