

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2018

Fecha de Información: 28 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\$2015.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.2%.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	367.9	231.0	124.0	297.0	50.0	13.9	57.0
15-35	446.1	801.6	403.6	203.3	215.0	59.8	183.0
36-60	46.6	117.9	20.0	0.0	52.9	1.6	45.0
61-90	77.4	53.0	3.0	55.0	35.0	7.4	15.0
91-180	1.5	70.5	0.0	0.0	70.5	1.5	0.0
>180	78.2	38.3	0.0	20.0	23.3	43.2	15.0
Total	1017.7	1312.5	550.6	575.3	446.8	127.3	315.1

* 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	0.0 %	0.4 %	-0.3 %	-0.1 %
15-35	0.0 %	0.1 %	0.1 %	0.1 %
36-60	0.1 %	0.5 %	0.2 %	0.4 %
61-90	0.8 %	1.2 %	1.0 %	1.0 %
91-180	-	1.4 %	1.1 %	1.4 %
>180	1.4 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
Total	0.1 %	0.4 %	0.1 %	0.2 %

*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	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	153	4594	4579	37	120	5035	5120	24	100	4477	4381
Intragruppo y off-shore***	0	0	2336	2101	0	0	2648	1835	0	0	1815	1231
Otros	153	37	1075	1325	120	37	1190	1917	100	24	1384	2063
Total	190	190	8005	8005	157	157	8873	8873	124	124	7676	7676

* 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.