

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2018

Fecha de Información: 03 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\$2027.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	376.0	267.1	111.3	199.5	78.8	99.5	77.0
15-35	616.1	674.8	404.3	180.0	107.5	273.1	163.0
36-60	149.6	87.8	0.0	13.5	87.8	136.1	0.0
61-90	22.0	10.3	0.0	10.0	10.3	12.0	0.0
91-180	23.1	23.6	20.0	20.0	3.6	3.1	0.0
>180	11.3	6.1	4.0	0.0	2.1	11.3	0.0
Total	1198.1	1069.7	539.6	423.0	290.1	535.1	240.0

* 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	1.6 %	1.7 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	0.8 %	0.6 %	0.7 %
61-90	-	1.8 %	1.1 %	1.4 %
91-180	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
>180	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.5 %	1.4 %	1.1 %	1.2 %

*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	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	116	5500	5498	37	103	4816	4814	25	129	2763	2687
Intragruppo y off-shore***	0	0	2829	2103	0	0	2062	1298	0	0	1046	997
Otros	116	33	1216	1943	103	37	1447	2213	129	25	901	1026
Total	149	149	9545	9545	140	140	8325	8325	155	155	4710	4710

* 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 intragrupo.