

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2018

Fecha de Información: 09 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\$2680.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	364.3	264.8	75.2	174.0	35.1	35.8	154.5
15-35	689.7	936.0	489.4	170.0	140.5	213.7	306.0
36-60	339.9	233.6	22.0	0.0	211.6	339.9	0.0
61-90	25.0	13.8	0.0	0.0	13.8	25.0	0.0
91-180	143.4	47.0	0.0	65.0	12.0	43.4	35.0
>180	67.7	50.7	50.0	50.0	0.7	17.7	0.0
Total	1629.9	1545.9	636.6	459.0	413.8	675.4	495.5

* 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	1.8 %	2.0 %	1.1 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.4 %	1.6 %
91-180	1.6 %	2.0 %	1.6 %	1.6 %
>180	-	1.9 %	1.3 %	1.3 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.5 %	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

Sector	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	115	5474	5490	28	133	3062	3048	18	121	3260	3540
Intragruppo y off-shore***	0	0	2350	1631	0	0	1194	1042	0	0	1590	1224
Otros	115	41	1569	2273	133	28	936	1102	121	18	1131	1217
Total	156	156	9393	9393	162	162	5192	5192	138	138	5981	5981

* 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.