

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2018

Fecha de Información: 17 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\$2179.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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 | 451.0 | 384.2 | 190.3 | 250.8 | 17.9 | 24.2 | 176.0 |
| 15-35 | 452.0 | 640.0 | 370.0 | 164.3 | 40.5 | 58.2 | 229.5 |
| 36-60 | 257.9 | 196.1 | 0.0 | 0.0 | 156.1 | 217.9 | 40.0 |
| 61-90 | 30.5 | 72.0 | 40.0 | 10.0 | 12.0 | 0.5 | 20.0 |
| 91-180 | 47.0 | 111.2 | 83.6 | 40.0 | 22.6 | 2.0 | 5.0 |
| >180 | 5.8 | 2.6 | 0.0 | 0.0 | 2.6 | 5.8 | 0.0 |
| Total | 1244.2 | 1406.2 | 683.9 | 465.0 | 251.8 | 308.6 | 470.5 |

* 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 intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1.3 % | 1.1 % | 1.2 % | 1.2 % |
| 15-35 | 1.3 % | 1.3 % | 1.1 % | 1.2 % |
| 36-60 | 1.3 % | 1.5 % | 1.4 % | 1.5 % |
| 61-90 | 1.4 % | 1.8 % | 1.3 % | 1.5 % |
| 91-180 | 1.3 % | 2.0 % | 1.4 % | 1.8 % |
| >180 | - | 1.8 % | 1.4 % | 1.5 % |
| Total | 1.3 % | 1.3 % | 1.3 % | 1.3 % |

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 15 al 19 de octubre | | | | 22 al 26 de octubre | | | | 29 de oct. al 2 de noviembre | | | |
|-----------------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 37 | 132 | 3677 | 3743 | 23 | 137 | 3748 | 4006 | 26 | 160 | 4489 | 4840 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1630 | 1381 | 0 | 0 | 1771 | 1342 | 0 | 0 | 2433 | 1539 |
| Otros | 132 | 37 | 972 | 1155 | 137 | 23 | 1183 | 1354 | 160 | 26 | 1186 | 1730 |
| Total | 170 | 170 | 6279 | 6279 | 160 | 160 | 6702 | 6702 | 186 | 186 | 8108 | 8108 |

* 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.