

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2018

Fecha de Información: 18 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\$2036.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	512.5	578.3	186.2	101.0	7.1	26.5	385.0
15-35	454.5	478.1	167.9	158.9	102.1	87.6	208.0
36-60	291.3	278.9	30.0	0.0	175.9	218.3	73.0
61-90	9.5	6.9	0.0	0.0	6.9	9.5	0.0
91-180	66.5	69.4	0.0	5.0	14.4	6.5	55.0
>180	10.4	0.8	0.0	0.0	0.8	10.4	0.0
Total	1344.7	1412.5	384.1	264.9	307.4	358.8	721.0

* 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	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.3 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.7 %	1.3 %	1.5 %
91-180	1.5 %	1.7 %	1.1 %	1.5 %
>180	-	2.0 %	1.4 %	1.4 %
Total	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %

*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

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**	36	131	3719	3744	25	139	4079	4407	27	160	4626	5012
Intragruppo y off-shore***	0	0	1631	1433	0	0	1901	1381	0	0	2488	1549
Otros	131	36	969	1142	139	25	1185	1378	160	27	1190	1743
Total	167	167	6320	6320	164	164	7166	7166	187	187	8304	8304

* 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.