

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2018

Fecha de Información: 19 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\$1453.5 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	191.7	393.0	233.0	30.0	30.0	31.7	130.0
15-35	535.5	333.3	148.8	271.8	46.0	125.3	138.5
36-60	65.0	68.5	0.0	0.0	68.5	65.0	0.0
61-90	21.0	5.5	3.2	15.0	2.3	6.0	0.0
91-180	63.4	96.5	20.0	0.0	21.5	8.4	55.0
>180	1.2	2.2	0.0	0.0	2.2	1.2	0.0
Total	877.8	899.2	405.1	316.8	170.6	237.6	323.5

* 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	1.5 %	1.4 %	0.7 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	2.2 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
>180	-	1.9 %	1.4 %	1.7 %
Total	1.5 %	1.6 %	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.

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	128	3720	3745	28	142	4175	4671	27	167	4719	5137
Intragruppo y off-shore***	0	0	1631	1433	0	0	2104	1411	0	0	2518	1549
Otros	128	36	970	1142	142	28	1196	1394	167	27	1205	1757
Total	164	164	6320	6320	169	169	7476	7476	194	194	8442	8442

* 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 intragruppo.