

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2018

Fecha de Información: 22 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\$1420.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	121.0	129.3	56.5	37.0	14.8	26.0	58.0
15-35	528.0	442.1	101.5	155.8	173.6	205.2	167.0
36-60	157.0	158.2	0.0	0.0	158.2	157.0	0.0
61-90	9.4	8.1	0.0	0.0	8.1	9.4	0.0
91-180	66.9	72.0	0.0	10.0	22.0	6.9	50.0
>180	1.6	2.3	0.0	0.0	2.3	1.6	0.0
Total	883.8	811.9	158.0	202.8	378.9	406.1	275.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	1.2 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.8 %	1.1 %	1.4 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.4 %	1.5 %
>180	-	2.9 %	1.5 %	2.3 %
Total	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %

*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	22 al 26 de octubre				29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	145	4253	4770	29	156	4759	5167	28	81	3148	3571
Intragruppo y off-shore***	0	0	2155	1438	0	0	2524	1559	0	0	1792	705
Otros	145	29	1207	1406	156	29	1210	1767	81	28	758	1422
Total	173	173	7614	7614	185	185	8493	8493	109	109	5698	5698

* 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.