

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2018

Fecha de Información: 23 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\$2087.2 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	296.0	201.8	119.5	163.5	17.3	67.4	65.0
15-35	668.0	829.4	424.3	103.8	157.1	316.2	248.0
36-60	156.5	109.1	1.0	15.0	83.1	116.5	25.0
61-90	8.9	26.7	0.0	0.0	26.7	8.9	0.0
91-180	45.6	23.3	0.0	10.0	8.3	20.6	15.0
>180	34.5	45.3	20.0	0.0	20.3	29.5	5.0
Total	1209.5	1235.7	564.8	292.3	312.9	559.2	358.0

* 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	1.5 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.4 %	1.7 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.5 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
Total	1.5 %	1.6 %	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**	30	151	4433	4910	30	158	4864	5257	28	81	3202	3633
Intragruppo y off-shore***	0	0	2248	1587	0	0	2550	1574	0	0	1834	712
Otros	151	30	1238	1423	158	30	1223	1806	81	28	766	1457
Total	181	181	7919	7919	188	188	8637	8637	109	109	5803	5803

* 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.