

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2018

Fecha de Información: 24 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\$1709.4 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	145.0	165.8	86.0	69.0	40.3	36.5	39.5
15-35	384.1	595.6	391.9	164.0	112.5	128.9	91.2
36-60	189.7	144.3	0.0	0.0	139.3	184.7	5.0
61-90	24.2	2.0	0.0	0.0	2.0	24.2	0.0
91-180	30.4	6.3	0.0	10.0	6.3	20.4	0.0
>180	79.4	88.4	55.0	21.1	23.4	48.3	10.0
Total	852.7	1002.4	532.9	264.1	323.8	442.9	145.7

* 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	1.8 %	1.6 %	1.0 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	2.3 %	1.2 %	1.3 %
91-180	-	2.4 %	1.2 %	1.4 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.3 %	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	155	4469	4987	31	158	4949	5342	28	81	3229	3642
Intragruppo y off-shore***	0	0	2312	1612	0	0	2572	1602	0	0	1839	728
Otros	155	29	1238	1420	158	31	1260	1839	81	28	768	1466
Total	184	184	8019	8019	189	189	8782	8782	109	109	5836	5836

* 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.