

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1592.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	137.7	159.0	93.0	47.7	6.0	30.0	60.0
15-35	609.5	624.0	243.8	199.8	93.3	122.7	287.0
36-60	73.6	95.3	0.0	0.0	95.3	73.6	0.0
61-90	9.5	20.2	10.5	0.0	9.7	9.5	0.0
91-180	11.1	14.0	0.0	0.0	13.7	10.7	0.4
>180	178.1	152.6	0.0	10.0	7.6	23.1	145.0
Total	1019.4	1065.2	347.3	257.5	225.6	269.6	492.4

* 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	1.6 %	1.8 %	0.3 %	1.2 %
15-35	1.7 %	2.7 %	1.4 %	1.9 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.6 %	1.1 %	1.5 %
91-180	1.4 %	1.7 %	1.0 %	1.4 %
>180	1.6 %	1.5 %	1.3 %	1.6 %
Total	1.6 %	2.2 %	1.3 %	1.7 %

*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

Sector	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**	27	150	4514	5068	36	141	5239	5706	40	84	3391	3905
Intragrupa y off-shore***	0	0	2375	1670	0	0	2730	1726	0	0	1985	759
Otros	150	27	1254	1405	141	36	1331	1869	84	40	782	1493
Total	178	178	8142	8142	178	178	9301	9301	125	125	6157	6157

* 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 intragrupo.