

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2018

Fecha de Información: 29 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\$1686.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	282.8	163.3	76.0	180.5	4.3	19.3	83.0
15-35	462.5	735.3	347.5	87.5	113.5	100.7	274.3
36-60	46.8	66.9	9.6	0.0	57.2	46.8	0.0
61-90	14.9	5.1	0.0	0.0	5.1	14.9	0.0
91-180	156.7	34.6	0.0	54.3	34.6	102.5	0.0
>180	62.5	61.8	0.0	0.0	11.8	12.5	50.0
Total	1026.2	1067.0	433.1	322.3	226.6	296.7	407.3

* 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	1.7 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	1.6 %	1.2 %	1.3 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.3 %
>180	1.7 %	2.1 %	1.3 %	1.7 %
Total	1.6 %	1.7 %	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

Sector	29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	145	5491	5859	57	84	3406	3916	35	116	3745	3840
Intragrupa y off-shore***	0	0	2806	1907	0	0	1985	759	0	0	1336	690
Otros	145	36	1337	1868	84	57	781	1497	116	35	1591	2142
Total	181	181	9634	9634	142	142	6172	6172	151	151	6671	6671

* 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.