

Fecha de Publicación: 2 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 31 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\$2375.5 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	471.0	248.9	87.7	366.9	84.7	27.6	76.5
15-35	522.1	804.0	508.7	167.3	119.8	179.3	175.5
36-60	177.6	171.7	0.0	1.9	121.7	125.7	50.0
61-90	59.6	12.4	0.0	40.0	12.4	19.5	0.0
91-180	99.6	74.8	20.0	20.0	44.7	69.5	10.0
>180	42.9	23.1	0.0	0.2	3.0	22.6	20.1
Total	1372.7	1334.9	616.4	596.3	386.4	444.3	332.1

* 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	1.9 %	2.1 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.3 %	1.8 %	1.2 %	1.3 %
91-180	1.4 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.5 %	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	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**	33	157	6065	6019	59	82	3522	4057	37	119	3971	4167
Intragrupa y off-shore***	0	0	2886	2413	0	0	2031	789	0	0	1415	725
Otros	157	33	1394	1914	82	59	822	1528	119	37	1693	2187
Total	190	190	10346	10346	141	141	6375	6375	156	156	7079	7079

* 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.