

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2018

Fecha de Información: 10 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\$2612.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	351.2	439.8	196.0	119.7	37.8	25.5	206.0
15-35	663.2	775.9	442.0	133.0	85.0	281.2	249.0
36-60	155.1	158.9	60.0	0.0	98.9	155.1	0.0
61-90	142.3	31.5	0.0	8.0	11.5	114.3	20.0
91-180	247.5	21.0	1.8	0.0	14.1	242.5	5.0
>180	85.2	21.2	0.0	45.0	21.2	40.2	0.0
Total	1644.5	1448.2	699.8	305.6	268.5	858.8	480.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	1.9 %	1.4 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.7 %	1.7 %	1.7 %
61-90	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.5 %
>180	-	0.1 %	1.6 %	1.1 %
Total	1.9 %	1.8 %	1.6 %	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

Sectores	8 al 12 de octubre				15 al 19 de octubre				22 al 26 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	120	5684	5616	30	133	3147	3242	18	119	3342	3687
Intragrupo y off-shore***	0	0	2357	1745	0	0	1313	1042	0	0	1667	1229
Otros	120	41	1594	2274	133	30	946	1122	119	18	1154	1247
Total	161	161	9635	9635	163	163	5406	5406	137	137	6163	6163

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.