

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2018

Fecha de Información: 12 de octubre de 2018¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1232.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	208.5	170.1	93.0	93.0	16.1	54.5	61.0
15-35	250.4	368.9	259.3	110.0	25.5	56.2	84.2
36-60	89.4	105.2	45.0	0.0	60.2	89.4	0.0
61-90	33.1	33.9	0.0	0.0	23.9	23.1	10.0
91-180	63.6	12.4	0.0	55.0	12.4	8.6	0.0
>180	41.0	20.9	10.0	11.9	0.9	19.1	10.0
Total	686.0	711.5	407.3	269.9	139.0	250.9	165.2

* 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	1.4 %		1.4 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.5 %		1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-		1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %		1.7 %	1.3 %	1.5 %
91-180	-		2.0 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.8 %		1.8 %	1.4 %	1.6 %
Total	1.5 %		1.6 %	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	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**	40	121	5860	5671	36	136	3351	3513	18	130	3585	3876
Intragrupo y off-shore***	0	0	2362	1881	0	0	1479	1125	0	0	1721	1273
Otros	121	40	1597	2267	136	36	975	1167	130	18	1163	1319
Total	162	162	9820	9820	171	171	5805	5805	148	148	6468	6468

* 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.