

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2018

Fecha de Información: 17 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\$2179.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	451.0	384.2	190.3	250.8	17.9	24.2	176.0
15-35	452.0	640.0	370.0	164.3	40.5	58.2	229.5
36-60	257.9	196.1	0.0	0.0	156.1	217.9	40.0
61-90	30.5	72.0	40.0	10.0	12.0	0.5	20.0
91-180	47.0	111.2	83.6	40.0	22.6	2.0	5.0
>180	5.8	2.6	0.0	0.0	2.6	5.8	0.0
Total	1244.2	1406.2	683.9	465.0	251.8	308.6	470.5

* 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	
3-14	1.3 %	1.1 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	1.3 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.4 %	1.8 %	1.3 %	1.5 %
91-180	1.3 %	2.0 %	1.4 %	1.8 %
>180	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
Total	1.3 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	15 al 19 de octubre				22 al 26 de octubre				29 de oct. al 2 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	132	3677	3743	23	137	3748	4006	26	160	4489	4840
Intragrupo y off-shore***	0	0	1630	1381	0	0	1771	1342	0	0	2433	1539
Otros	132	37	972	1155	137	23	1183	1354	160	26	1186	1730
Total	170	170	6279	6279	160	160	6702	6702	186	186	8108	8108

* 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.