Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2018

Fecha de Información: 11 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$1924.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.[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	364.8	300.7	107.3	139.0	25.4	57.8	168.0
15-35	507.7	645.9	364.8	101.0	29.6	155.2	251.5
36-60	192.1	140.4	20.0	0.0	120.4	192.1	0.0
61-90	61.6	47.1	0.0	20.0	27.1	21.6	20.0
91-180	44.8	13.5	0.0	39.0	13.5	5.8	0.0
>180	29.3	16.6	15.0	19.0	1.6	10.3	0.0
Total	**1200.2**	**1164.1**	**507.0**	**318.0**	**217.6**	**442.7**	**439.5**

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

*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	122	5860	5671	33	135	3257	3391	18	125	3474	3831
Intragrupo y off-shore***	0	0	2362	1881	0	0	1397	1069	0	0	1710	1236
Otros	122	40	1597	2267	135	33	966	1159	125	18	1159	1276
Total	**162**	**162**	**9820**	**9820**	**168**	**168**	**5619**	**5619**	**143**	**143**	**6343**	**6343**

* 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.