Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2018

Fecha de Información: 16 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$1159.2 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	102.4	94.4	64.0	94.8	30.4	7.6	0.0
15-35	280.4	320.5	151.5	174.0	112.0	49.4	57.0
36-60	174.3	120.7	0.0	0.0	120.7	174.3	0.0
61-90	4.2	52.3	0.0	0.0	52.3	4.2	0.0
91-180	16.8	23.0	0.0	15.0	23.0	1.8	0.0
>180	7.9	19.3	17.6	0.0	1.8	7.9	0.0
Total	**586.0**	**630.2**	**233.1**	**283.8**	**340.1**	**245.3**	**57.0**

* 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	-	1.7 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.7 %
91-180	-	1.7 %	1.4 %	1.6 %
>180	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %

*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**	36	131	3417	3588	19	134	3618	3892	26	160	4430	4746
Intragrupo y off-shore***	0	0	1538	1204	0	0	1726	1288	0	0	2379	1519
Otros	131	36	991	1154	134	19	1174	1337	160	26	1180	1726
Total	**167**	**167**	**5946**	**5946**	**153**	**153**	**6518**	**6518**	**186**	**186**	**7990**	**7990**

* 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.