

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$1952.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	245.2	358.9	146.0	95.0	132.4	69.7	80.5
15-35	312.7	343.4	235.0	179.5	71.4	96.2	37.0
36-60	159.6	183.5	24.7	0.0	144.8	145.6	14.0
61-90	44.4	3.5	0.0	37.1	3.5	7.3	0.0
91-180	252.4	225.9	120.0	9.5	45.9	182.9	60.0
>180	1.8	12.9	0.0	0.0	12.9	1.8	0.0
Total	1016.1	1128.2	525.7	321.1	411.0	503.5	191.5

* 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	1.7 %	1.7 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.6 %	1.5 %
36-60	1.6 %	1.6 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.3 %	1.5 %	1.3 %	1.3 %
>180	-	1.9 %	1.4 %	1.8 %
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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	163	6079	6035	60	89	3576	4128	43	121	4152	4477
Intragrupa y off-shore***	0	0	2888	2413	0	0	2035	789	0	0	1595	820
Otros	163	32	1395	1914	89	60	842	1535	121	43	1793	2243
Total	195	195	10362	10362	149	149	6453	6453	164	164	7539	7539

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