

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 02 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\$1756.4 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	321.4	287.2	95.0	107.0	47.2	69.4	145.0
15-35	456.9	514.5	237.5	198.6	41.5	22.8	235.5
36-60	3.6	6.3	0.0	0.2	6.3	3.4	0.0
61-90	116.1	139.9	0.0	0.0	139.9	116.1	0.0
91-180	145.8	107.6	10.0	0.0	32.6	80.8	65.0
>180	47.0	95.4	40.0	0.0	15.4	7.0	40.0
Total	1090.8	1151.1	382.5	305.8	283.1	299.5	485.5

* 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 %	1.6 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	1.5 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.3 %	1.5 %	1.1 %	1.3 %
>180	1.4 %	1.7 %	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

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	162	6079	6035	60	95	3770	4233	46	124	4275	4651
Intragrupa y off-shore***	0	0	2888	2413	0	0	2060	896	0	0	1665	820
Otros	162	32	1395	1914	95	60	862	1563	124	46	1811	2282
Total	195	195	10362	10362	155	155	6692	6692	170	170	7752	7752

* 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.