

Fecha de Publicación: 9 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 07 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\$2579.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	587.1	395.3	184.5	397.0	44.8	24.1	166.0
15-35	771.7	898.7	407.5	165.9	95.2	209.9	396.0
36-60	76.8	67.5	0.0	10.8	7.5	6.0	60.0
61-90	88.6	93.2	0.0	0.0	93.2	88.6	0.0
91-180	126.5	15.5	0.0	40.0	15.5	86.5	0.0
>180	37.1	53.5	2.1	0.0	41.4	27.1	10.0
Total	1687.8	1523.6	594.1	613.6	297.5	442.2	632.0

* 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	1.8 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.6 %	3.0 %	1.4 %	1.6 %
61-90	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.7 %	1.3 %	1.3 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.4 %	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

Sector	5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	99	4738	4363	50	133	4571	4979	26	135	3356	4099
Intragrupa y off-shore***	0	0	2130	1787	0	0	1841	969	0	0	1994	1067
Otros	99	57	862	1580	133	50	1889	2352	135	26	1060	1245
Total	156	156	7730	7730	183	183	8300	8300	162	162	6411	6411

* 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.