

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 08 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\$2473.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	337.5	220.0	105.0	220.0	42.5	45.0	72.5
15-35	659.4	998.3	541.3	65.3	25.0	162.1	432.0
36-60	1.2	47.8	22.6	0.0	25.3	1.2	0.0
61-90	391.4	241.2	0.0	0.0	181.2	331.4	60.0
91-180	31.2	42.6	0.0	0.0	12.6	1.2	30.0
>180	64.4	72.8	1.0	0.6	31.7	23.8	40.0
Total	1485.0	1622.7	669.9	285.9	318.4	564.6	634.5

* 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	1.9 %	1.9 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	2.2 %	1.1 %	2.1 %
61-90	1.6 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.4 %	1.7 %	1.1 %	1.5 %
>180	1.5 %	1.8 %	1.7 %	1.6 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %

*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**	58	98	4866	4405	51	133	4695	5082	27	137	3440	4191
Intragrupa y off-shore***	0	0	2150	1887	0	0	1913	1052	0	0	2020	1104
Otros	98	58	865	1589	133	51	1900	2374	137	27	1092	1257
Total	156	156	7881	7881	184	184	8508	8508	164	164	6552	6552

* 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.