

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 09 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\$1627.8 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	110.7	223.1	208.5	81.5	14.6	29.2	0.0
15-35	713.2	696.0	338.7	264.6	29.3	120.6	328.0
36-60	3.9	5.0	0.0	2.5	5.0	1.4	0.0
61-90	23.8	11.3	0.0	0.0	1.3	13.8	10.0
91-180	88.6	76.6	50.0	29.6	16.6	49.0	10.0
>180	11.2	22.5	0.0	0.0	12.5	1.2	10.0
Total	951.4	1034.4	597.2	378.2	79.2	215.2	358.0

* 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	-	1.6 %	0.7 %	1.3 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	3.5 %	0.6 %	2.9 %
61-90	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
>180	1.5 %	1.9 %	1.2 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.8 %	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**	56	97	4866	4403	53	135	4785	5192	28	139	3457	4304
Intragrupa y off-shore***	0	0	2150	1887	0	0	2010	1125	0	0	2132	1112
Otros	97	56	863	1589	135	53	1913	2391	139	28	1094	1266
Total	153	153	7879	7879	188	188	8707	8707	168	168	6683	6683

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.