

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 13 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\$2051.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	439.9	339.2	138.5	220.0	12.2	31.4	188.5
15-35	559.1	915.9	542.5	212.7	100.9	73.9	272.5
36-60	19.5	21.2	0.0	0.0	6.2	4.5	15.0
61-90	55.4	47.2	0.0	0.0	47.2	55.4	0.0
91-180	5.0	41.9	0.0	0.0	41.9	5.0	0.0
>180	44.1	58.9	15.0	10.0	23.9	14.1	20.0
Total	1123.1	1424.4	696.0	442.7	232.4	184.4	496.0

* 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	2.0 %	1.4 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
36-60	1.9 %	2.4 %	1.2 %	1.9 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	2.6 %	0.6 %	2.4 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %

*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	12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	141	5088	5352	32	140	3564	4415	22	138	4241	4588
Intragrupa y off-shore***	0	0	2085	1345	0	0	2155	1112	0	0	1798	988
Otros	141	52	1918	2394	140	32	1093	1285	138	22	1057	1520
Total	193	193	9091	9091	173	173	6812	6812	160	160	7096	7096

* 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.