

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 14 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\$3016.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	333.6	126.2	57.0	250.2	27.2	41.4	42.0
15-35	946.2	1174.5	582.7	304.0	205.9	256.1	386.0
36-60	4.5	19.3	18.0	0.0	1.3	4.5	0.0
61-90	140.3	106.1	10.5	1.0	85.6	129.3	10.0
91-180	274.6	334.1	200.1	0.0	39.0	179.6	95.0
>180	78.9	56.1	0.0	30.0	11.1	3.9	45.0
Total	1778.2	1816.5	868.3	585.2	370.2	615.0	578.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.6 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.7 %	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	145	5326	5368	32	140	3605	4484	23	140	4334	4659
Intragruppo y off-shore***	0	0	2085	1567	0	0	2205	1122	0	0	1829	1036
Otros	145	52	1924	2400	140	32	1094	1298	140	23	1082	1551
Total	197	197	9334	9334	172	172	6904	6904	163	163	7245	7245

* 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 intragruppo.