

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 15 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\$2455.1 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	469.4	363.2	119.5	254.5	105.7	76.9	138.0
15-35	727.2	988.2	558.6	184.5	115.9	229.1	313.6
36-60	31.4	35.6	0.0	0.0	7.6	3.4	28.0
61-90	55.7	141.0	0.0	2.2	139.8	52.3	1.2
91-180	47.9	57.9	0.0	0.0	17.9	7.9	40.0
>180	45.2	43.3	0.0	9.6	13.3	5.6	30.0
Total	1376.9	1629.1	678.1	450.8	400.1	375.2	550.8

* 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 %	1.8 %	1.7 %
15-35	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
36-60	1.8 %	2.9 %	1.5 %	2.0 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.5 %	1.5 %	1.1 %	1.5 %
>180	1.5 %	1.9 %	1.5 %	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.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	147	5427	5453	31	142	3729	4528	23	140	4575	4884
Intragruppo y off-shore***	0	0	2116	1630	0	0	2239	1234	0	0	1884	1115
Otros	147	52	1937	2397	142	31	1098	1303	140	23	1162	1622
Total	198	198	9480	9480	173	173	7066	7066	163	163	7621	7621

* 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.