

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 19 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\$1478.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	286.5	271.9	86.6	98.0	38.3	41.5	147.0
15-35	431.1	498.0	181.5	160.2	53.0	7.4	263.5
36-60	100.4	70.4	0.0	0.0	70.4	100.4	0.0
61-90	77.4	75.8	0.0	0.0	75.8	77.4	0.0
91-180	18.9	36.6	0.0	7.1	36.6	11.8	0.0
>180	2.4	19.4	0.0	0.0	19.4	2.4	0.0
Total	916.7	972.2	268.1	265.3	293.6	240.9	410.5

* 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	2.1 %	2.0 %	1.5 %	1.9 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	3.5 %	1.6 %	2.4 %
61-90	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
>180	-	1.9 %	1.0 %	1.8 %
Total	1.9 %	2.1 %	1.6 %	1.9 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	147	4264	4884	25	148	4650	5013	24	118	3344	4276
Intragruppo y off-shore***	0	0	2344	1538	0	0	1932	1120	0	0	1958	836
Otros	147	35	1125	1310	148	25	1223	1672	118	24	1215	1405
Total	182	182	7733	7733	173	173	7805	7805	142	142	6517	6517

* 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.