

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 23 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\$1273.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	164.8	174.5	108.5	77.0	11.0	32.8	55.0
15-35	318.0	511.3	275.5	122.0	84.3	44.5	151.5
36-60	6.2	4.2	0.0	0.0	4.2	6.2	0.0
61-90	148.7	94.4	0.0	30.0	88.8	113.1	5.6
91-180	11.9	24.6	14.6	1.5	10.0	10.4	0.0
>180	26.4	0.5	0.0	0.0	0.5	26.4	0.0
Total	676.0	809.5	398.6	230.5	198.8	233.4	212.1

* 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 %	2.3 %	0.4 %	1.5 %
15-35	1.9 %	1.8 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.5 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
91-180	-	1.6 %	0.8 %	1.3 %
>180	-	2.0 %	1.3 %	1.3 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.2 %	1.6 %

*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	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**	34	146	4768	5030	31	152	5088	5498	29	120	3481	4588
Intragruppo y off-shore***	0	0	2384	1943	0	0	2231	1354	0	0	2157	857
Otros	146	34	1137	1316	152	31	1246	1713	120	29	1249	1442
Total	180	180	8289	8289	183	183	8564	8564	149	149	6887	6887

* 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.