

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1524.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	306.6	287.7	150.5	142.4	21.2	48.1	116.0
15-35	293.6	347.6	179.8	131.0	27.4	22.2	140.4
36-60	99.5	134.1	16.9	0.0	57.2	39.5	60.0
61-90	113.4	22.6	0.0	0.0	22.6	113.4	0.0
91-180	17.7	58.1	30.6	1.0	17.5	6.7	10.0
>180	112.1	108.2	20.0	50.0	37.8	11.7	50.4
Total	942.9	958.4	397.8	324.4	183.8	241.6	376.8

* 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	2.1 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	1.6 %	4.5 %	1.6 %	2.8 %
61-90	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.9 %	2.3 %	1.6 %	2.0 %

*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	26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	160	5313	5731	31	120	3537	4619	25	125	5056	5551
Intragruppo y off-shore***	0	0	2367	1465	0	0	2171	889	0	0	2010	861
Otros	160	33	1252	1735	120	31	1257	1457	125	25	1918	2571
Total	193	193	8932	8932	151	151	6965	6965	150	150	8983	8983

* 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.