

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 29 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\$2014.2 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	214.2	232.4	95.6	88.5	52.8	41.7	84.0
15-35	509.6	576.6	214.7	184.3	120.2	83.6	241.7
36-60	133.8	134.2	14.0	34.0	35.2	14.8	85.0
61-90	248.2	239.6	56.0	5.0	159.6	219.2	24.0
91-180	12.3	27.4	0.0	0.0	27.4	12.3	0.0
>180	103.6	109.1	10.0	9.6	7.1	2.0	92.0
Total	1221.7	1319.2	390.3	321.4	402.3	373.7	526.7

* 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	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.1 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.1 %	3.1 %	1.9 %	2.2 %
61-90	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.3 %	1.7 %
>180	1.7 %	2.8 %	1.6 %	1.8 %
Total	2.0 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %

*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	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	170	5808	6074	56	130	3770	4891	36	127	5309	5920
Intragruppo y off-shore***	0	0	2568	1831	0	0	2337	1015	0	0	2165	936
Otros	170	33	1274	1745	130	56	1295	1496	127	36	2042	2660
Total	204	204	9650	9650	186	186	7402	7402	162	162	9516	9516

* 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.