

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 30 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\$1356.5 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	156.6	161.2	94.0	119.0	45.2	15.6	22.0
15-35	283.9	354.0	173.4	182.2	94.5	15.7	86.1
36-60	32.1	59.9	20.0	0.0	9.9	2.1	30.0
61-90	134.2	251.8	20.0	0.0	189.3	91.7	42.5
91-180	7.7	39.2	10.9	0.0	28.2	7.7	0.0
>180	46.5	38.9	0.0	9.6	9.9	7.9	29.0
Total	661.1	905.0	318.3	310.8	377.1	140.7	209.6

* 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	3.0 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.6 %	2.0 %
36-60	2.1 %	1.0 %	1.3 %	1.5 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.9 %	1.8 %
91-180	-	1.5 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.6 %	2.2 %	1.5 %	1.7 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %

*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	166	5808	6077	56	132	3921	4989	40	126	5319	5979
Intragruppo y off-shore***	0	0	2568	1831	0	0	2408	1132	0	0	2189	938
Otros	166	33	1277	1745	132	56	1307	1515	126	40	2071	2662
Total	199	199	9653	9653	188	188	7635	7635	166	166	9579	9579

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