

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 03 de diciembre 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\$1668.1 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	459.2	126.7	31.0	370.8	22.7	15.4	73.0
15-35	234.7	353.3	256.8	145.5	20.9	13.7	75.5
36-60	155.5	157.3	30.0	18.0	95.8	106.0	31.5
61-90	62.3	38.1	0.0	0.0	38.1	62.3	0.0
91-180	51.2	144.4	85.0	10.0	34.4	16.2	25.0
>180	50.8	58.8	0.0	0.0	39.8	31.8	19.0
Total	1013.6	878.5	402.8	544.3	251.6	245.3	224.0

* 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	1.9 %	2.3 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.8 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	130	4168	5036	43	136	5379	6010	56	196	3317	4614
Intragruppo y off-shore***	0	0	2421	1339	0	0	2189	967	0	0	2551	1351
Otros	130	53	1308	1522	136	43	2082	2673	196	56	690	594
Total	183	183	7897	7897	179	179	9649	9649	251	251	6558	6558

* 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.