

Fecha de Publicación: 6 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 04 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\$2075.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	591.9	293.4	109.5	402.9	61.7	66.8	122.2
15-35	304.0	468.3	346.2	184.3	24.5	22.3	97.5
36-60	66.0	40.6	0.0	0.0	40.6	66.0	0.0
61-90	110.5	84.1	1.0	0.0	81.1	108.5	2.0
91-180	158.3	85.1	24.1	153.9	61.1	4.4	0.0
>180	14.9	94.3	35.0	0.0	45.3	0.9	14.0
Total	1245.7	1065.7	515.8	741.1	314.2	268.9	235.7

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	2.1 %	1.9 %	1.9 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-	1.8 %	1.2 %	1.7 %
>180	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
Total	2.0 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %

*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	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	128	4487	5085	44	140	5527	6147	56	201	3450	4718
Intragrupa y off-shore***	0	0	2451	1648	0	0	2206	977	0	0	2614	1434
Otros	128	53	1321	1525	140	44	2126	2735	201	56	692	604
Total	181	181	8258	8258	184	184	9859	9859	256	256	6756	6756

* 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 intragrupo.