

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 07 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\$2227.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	693.5	287.2	82.5	544.5	73.7	18.0	131.0
15-35	388.5	698.4	509.0	171.0	35.4	63.5	154.0
36-60	5.1	81.4	0.0	0.0	81.4	5.1	0.0
61-90	168.7	106.3	0.0	85.0	83.8	61.2	22.5
91-180	3.6	63.4	40.0	0.0	23.4	3.6	0.0
>180	20.9	32.6	0.0	0.0	17.6	5.9	15.0
Total	1280.4	1269.3	631.5	800.5	315.3	157.3	322.5

* 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	2.1 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.5 %	1.6 %	1.6 %
36-60	-	1.9 %	1.4 %	1.8 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
91-180	-	1.6 %	1.3 %	1.6 %
>180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.8 %	1.6 %	1.4 %	1.6 %

*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**	54	133	4809	5197	45	146	6412	6526	54	208	3928	5100
Intragruppo y off-shore***	0	0	2466	1897	0	0	2291	1610	0	0	2846	1769
Otros	133	54	1353	1535	146	45	2248	2813	208	54	734	639
Total	187	187	8628	8628	191	191	10950	10950	263	263	7508	7508

* 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.