

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 10 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\$2442.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	475.8	268.7	142.5	320.2	39.2	68.6	87.0
15-35	446.8	681.9	400.0	149.3	12.0	27.5	270.0
36-60	127.6	184.2	20.0	0.0	89.2	52.6	75.0
61-90	190.5	264.3	13.3	0.0	211.0	150.5	40.0
91-180	1.1	34.8	20.0	0.0	14.8	1.1	0.0
>180	186.6	161.6	5.0	50.0	46.6	26.6	110.0
Total	1428.5	1595.6	600.7	519.5	412.8	327.0	582.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	1.6 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
>180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
Total	1.6 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %

*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	10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	144	6827	6722	55	209	3984	5167	15	157	1975	2369
Intragrupa y off-shore***	0	0	2374	1903	0	0	2905	1796	0	0	1229	931
Otros	144	45	2272	2849	208	55	742	667	157	15	370	274
Total	190	190	11474	11474	263	263	7631	7631	172	172	3574	3574

* 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 intragrupo.