

Fecha de Publicación: 22 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 20 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\$2579.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	548.2	245.3	133.0	435.2	20.8	21.5	91.5
15-35	512.5	1102.0	767.7	172.3	72.3	78.2	262.0
36-60	136.5	104.4	75.0	34.0	4.4	77.5	25.0
61-90	67.8	69.5	0.0	0.0	69.5	67.8	0.0
91-180	27.8	26.2	10.0	24.0	16.2	3.8	0.0
>180	62.9	100.2	30.0	10.0	25.2	7.9	45.0
Total	1355.6	1647.5	1015.7	675.5	208.4	256.7	423.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %	1.8 %	2.1 %	2.1 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.5 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.9 %	1.8 %	1.9 %	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

Sectores	19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	144	4600	4938	25	148	4842	5170	24	118	3365	4475
Intragrupo y off-shore***	0	0	2374	1847	0	0	2035	1247	0	0	2128	836
Otros	144	36	1121	1310	148	25	1232	1690	118	24	1226	1408
Total	180	180	8095	8095	174	174	8108	8108	143	143	6719	6719

* 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.