

Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 05 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\$1660.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	376.9	209.2	47.5	240.7	73.9	48.4	87.8
15-35	442.3	499.4	242.5	156.2	29.4	58.6	227.5
36-60	47.1	99.1	0.0	0.0	99.1	47.1	0.0
61-90	104.3	137.7	0.0	0.0	137.7	104.3	0.0
91-180	2.8	19.1	0.0	0.0	19.1	2.8	0.0
>180	7.7	35.3	0.0	0.0	30.3	2.7	5.0
Total	981.2	999.9	290.0	396.9	389.6	264.0	320.3

* 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 %	1.7 %	2.7 %	2.3 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.8 %
>180	1.5 %	1.9 %	1.3 %	1.8 %
Total	1.9 %	1.9 %	2.1 %	2.0 %

*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	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	4679	5122	45	142	5668	6276	56	203	3526	4842
Intragruppo y off-shore***	0	0	2451	1836	0	0	2254	1030	0	0	2672	1434
Otros	130	53	1353	1525	142	45	2154	2770	203	56	700	622
Total	183	183	8484	8484	187	187	10076	10076	259	259	6898	6898

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.