

Fecha de Publicación: 4 de enero de 2019

Fecha de Información: 02 de enero de 2019 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\$802.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	210.1	62.0	46.3	195.6	15.7	14.6	0.0
15-35	141.7	345.2	285.0	78.5	9.2	12.2	51.0
36-60	0.7	6.4	0.0	0.0	6.4	0.7	0.0
61-90	55.1	65.1	0.0	0.5	15.1	4.6	50.0
91-180	0.2	7.3	0.0	0.0	7.3	0.2	0.0
>180	0.9	8.9	0.0	0.0	8.9	0.9	0.0
Total	408.7	494.9	331.3	274.6	62.6	33.1	101.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	-	2.2 %	1.2 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.3 %	1.4 %	2.2 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
91-180	-	1.7 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.1 %	1.8 %
Total	1.7 %	2.0 %	1.4 %	1.7 %

*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	31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero				14 al 18 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	57	2077	2345	21	85	2785	3700	32	121	4338	4390
Intragruo y off-shore***	0	0	1375	1094	0	0	2299	1118	0	0	2072	1124
Otros	57	25	170	182	85	21	321	588	121	32	1061	1957
Total	82	82	3622	3622	106	106	5405	5405	154	154	7472	7472

* 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 intragruo.