

Fecha de Publicación: 8 de enero de 2019

Fecha de Información: 03 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\$1757.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	427.0	245.6	203.5	394.5	38.4	28.8	3.7
15-35	339.2	518.9	441.7	255.8	16.0	22.3	61.2
36-60	17.6	119.0	100.0	0.0	19.0	17.6	0.0
61-90	42.2	47.6	20.0	0.0	27.6	42.2	0.0
91-180	10.7	43.0	35.0	0.0	3.0	5.7	5.0
>180	0.0	16.3	15.0	0.0	1.3	0.0	0.0
Total	836.6	990.3	815.2	650.3	105.2	116.5	69.9

* 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	1.7 %	2.0 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	4.7 %	1.5 %	2.8 %
91-180	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
>180	-	1.6 %	-	1.6 %
Total	1.7 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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	56	2173	2358	22	88	3027	3810	35	122	4422	4509
Intragrupo y off-shore***	0	0	1382	1188	0	0	2379	1344	0	0	2189	1199
Otros	56	25	172	181	88	22	351	605	122	35	1064	1967
Total	81	81	3726	3726	111	111	5758	5758	157	157	7674	7674

* 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.