

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2019

Fecha de Información: 08 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\$1309.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	236.8	209.9	146.1	200.0	50.9	23.8	13.0
15-35	514.9	226.6	168.0	456.4	46.6	46.5	12.0
36-60	51.0	29.9	1.0	0.0	28.9	51.0	0.0
61-90	12.2	23.6	0.0	0.0	23.6	12.2	0.0
91-180	0.4	26.1	0.0	0.0	26.1	0.4	0.0
>180	1.5	1.2	0.0	0.0	1.2	1.5	0.0
Total	816.9	517.3	315.1	656.4	177.2	135.5	25.0

* 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	1.5 %	1.7 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	0.6 %	1.8 %
>180	-	1.7 %	1.3 %	1.5 %
Total	1.5 %	1.7 %	1.4 %	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

Sectores	7 al 11 de enero				14 al 18 de enero				21 al 25 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	100	3386	3886	36	128	4508	4664	21	90	1799	2249
Intragrupo y off-shore***	0	0	2421	1686	0	0	2293	1237	0	0	1031	418
Otros	100	22	377	612	128	36	1099	2000	90	21	658	820
Total	122	122	6184	6184	165	165	7901	7901	111	111	3487	3487

* 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.