

Fecha de Publicación: 11 de enero de 2019

Fecha de Información: 09 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\$1802.4 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	487.6	206.5	77.0	378.7	57.5	36.9	72.0
15-35	433.8	625.8	472.4	244.8	29.9	65.6	123.5
36-60	29.5	41.9	1.5	23.0	40.4	6.5	0.0
61-90	75.4	26.0	0.0	0.0	26.0	75.4	0.0
91-180	0.7	19.9	0.0	0.0	19.9	0.7	0.0
>180	30.1	20.8	15.0	30.0	5.8	0.1	0.0
Total	1057.1	940.8	565.9	676.5	179.4	185.1	195.5

* 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	1.4 %	1.9 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.8 %
>180	-	1.6 %	1.5 %	1.5 %
Total	1.4 %	1.7 %	1.2 %	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	101	3667	3976	36	132	4701	4763	22	93	1817	2271
Intragrupo y off-shore***	0	0	2467	1941	0	0	2324	1360	0	0	1034	418
Otros	101	22	395	612	132	36	1121	2023	93	22	676	839
Total	123	123	6529	6529	168	168	8146	8146	115	115	3527	3527

* 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 intragrupo.