

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1538.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	366.0	489.4	80.5	92.5	168.9	33.5	240.0
15-35	368.8	434.4	285.0	175.2	21.4	65.6	128.0
36-60	2.2	9.9	0.0	0.0	9.9	2.2	0.0
61-90	128.2	27.0	0.0	0.0	14.5	115.7	12.5
91-180	0.3	23.9	0.0	0.0	23.9	0.3	0.0
>180	30.1	69.3	20.0	0.0	19.3	0.1	30.0
Total	895.5	1053.7	385.5	267.7	257.7	217.3	410.5

* 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 %	0.9 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.7 %	0.9 %	2.3 %
61-90	1.5 %	1.8 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.8 %	1.1 %	1.8 %
>180	1.6 %	1.7 %	0.5 %	1.7 %
Total	1.5 %	1.3 %	1.3 %	1.4 %

* 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**	23	103	3702	3976	40	134	5014	5224	22	96	1830	2294
Intragrupo y off-shore***	0	0	2467	1979	0	0	2396	1414	0	0	1043	418
Otros	103	23	395	608	134	40	1280	2052	96	22	682	842
Total	126	126	6564	6564	174	174	8690	8690	117	117	3554	3554

* 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.