

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2019

Fecha de Información: 14 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\$1609.5 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	346.5	175.8	81.9	197.5	36.4	91.5	57.5
15-35	599.2	643.0	208.5	204.9	149.0	108.8	285.5
36-60	11.6	26.7	0.0	0.0	26.7	11.6	0.0
61-90	0.3	17.4	0.0	0.0	17.4	0.3	0.0
91-180	10.8	30.6	0.0	0.0	30.6	10.8	0.0
>180	9.5	81.2	0.0	9.1	81.2	0.4	0.0
Total	977.9	974.6	290.4	411.5	341.2	223.4	343.0

* 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 %	2.1 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-	2.3 %	1.4 %	2.0 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.5 %	1.8 %	1.3 %	1.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	14 al 18 de enero				21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	138	5436	5437	30	102	1924	2473	27	90	2655	2712
Intragrupo y off-shore***	0	0	2496	1719	0	0	1158	439	0	0	1037	844
Otros	138	39	1362	2138	102	30	691	861	90	27	1016	1152
Total	176	176	9294	9294	132	132	3773	3773	117	117	4707	4707

* 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.