

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2019

Fecha de Información: 16 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\$2209.1 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	388.4	266.8	77.0	124.0	24.8	99.4	165.0
15-35	713.6	721.7	244.7	192.5	159.5	203.6	317.5
36-60	166.8	68.6	20.0	10.0	23.6	131.8	25.0
61-90	167.1	11.3	0.0	5.0	11.3	162.1	0.0
91-180	3.9	29.9	0.0	0.0	29.9	3.9	0.0
>180	5.6	172.8	30.0	5.2	142.8	0.4	0.0
Total	1445.3	1271.3	371.7	336.7	392.0	601.1	507.5

* 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	
3-14	1.4 %	2.2 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
36-60	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.4 %
91-180	-	2.0 %	1.4 %	1.9 %
>180	-	1.7 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.4 %	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	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**	37	145	5802	5603	31	109	2104	2683	27	96	2823	2845
Intragrupo y off-shore***	0	0	2569	1958	0	0	1267	476	0	0	1062	873
Otros	145	37	1357	2167	109	31	737	949	96	27	1027	1194
Total	182	182	9728	9728	140	140	4108	4108	123	123	4912	4912

* 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.