

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2019

Fecha de Información: 17 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\$1860.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	511.9	223.4	77.8	327.1	21.6	60.8	124.0
15-35	469.0	613.6	352.3	141.0	134.8	201.4	126.6
36-60	12.7	144.3	134.0	0.0	10.3	12.7	0.0
61-90	51.4	34.0	20.0	20.0	9.0	26.4	5.0
91-180	0.2	16.6	0.7	0.0	15.9	0.2	0.0
>180	35.6	38.1	0.0	0.0	3.1	0.6	35.0
Total	1080.8	1070.0	584.8	488.1	194.5	302.1	290.6

* 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 %	1.3 %	1.0 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.3 %	1.4 %	1.3 %
61-90	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
91-180	-	1.8 %	0.6 %	1.7 %
>180	1.6 %	1.8 %	0.7 %	1.6 %
Total	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %

*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**	38	143	6344	6061	32	112	2351	2773	27	96	2919	2894
Intragrupo y off-shore***	0	0	2580	2061	0	0	1334	690	0	0	1062	883
Otros	143	38	1801	2604	112	32	689	910	96	27	1025	1229
Total	180	180	10725	10725	143	143	4373	4373	123	123	5006	5006

* 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.