

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2019

Fecha de Información: 18 de enero de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1494.1 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	331.5	109.8	23.0	225.6	26.8	45.9	60.0
15-35	386.2	608.4	350.9	196.0	143.5	76.2	114.0
36-60	77.2	77.2	30.0	0.0	17.2	47.2	30.0
61-90	26.4	22.3	0.0	10.0	12.3	6.4	10.0
91-180	1.2	39.7	0.0	0.0	39.7	1.2	0.0
>180	11.8	16.5	10.0	10.0	6.5	1.8	0.0
Total	834.4	873.7	413.9	441.6	245.9	178.8	214.0

* 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 %		1.8 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %		1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.5 %		1.7 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %		1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-		1.8 %	1.4 %	1.8 %
>180	-		2.2 %	1.4 %	1.7 %
Total	1.5 %		1.6 %	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	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	142	6344	6059	31	117	2795	3049	27	97	2972	2886
Intragrupo y off-shore***	0	0	2580	2061	0	0	1357	873	0	0	1062	926
Otros	142	38	1800	2604	117	31	882	1112	97	27	1017	1240
Total	180	180	10724	10724	148	148	5034	5034	124	124	5051	5051

* 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.