

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2019

Fecha de Información: 21 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\$295.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	65.1	171.2	115.0	5.0	2.2	6.1	54.0
15-35	47.4	56.6	55.0	46.0	1.6	1.4	0.0
36-60	0.0	1.2	0.0	0.0	1.2	0.0	0.0
61-90	0.0	0.4	0.0	0.0	0.4	0.0	0.0
91-180	0.4	6.3	0.0	0.0	6.3	0.4	0.0
>180	0.1	1.0	0.0	0.0	1.0	0.1	0.0
Total	113.1	236.6	170.0	51.0	12.6	8.1	54.0

* 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	1.6 %	1.6 %	-4.4 %	0.8 %
15-35	-	1.6 %	1.1 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	0.8 %	1.7 %
61-90	-	2.3 %	-	2.3 %
91-180	-	2.0 %	1.3 %	2.0 %
>180	-	1.6 %	0.2 %	1.5 %
Total	1.6 %	1.7 %	-2.1 %	1.0 %

*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	21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	114	3042	3292	27	97	2960	2979	13	78	3180	2999
Intragrupo y off-shore***	0	0	1367	878	0	0	1167	926	0	0	1816	1460
Otros	114	30	1087	1326	97	27	979	1201	78	13	590	1128
Total	143	143	5496	5496	124	124	5105	5105	91	91	5587	5587

* 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.