

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1653.1 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	236.2	196.1	92.0	108.0	19.1	43.3	85.0
15-35	493.5	613.3	155.5	109.0	322.3	249.0	135.5
36-60	108.6	87.5	0.0	0.1	6.0	27.0	81.5
61-90	42.3	16.1	3.8	20.0	7.3	17.3	5.0
91-180	7.4	21.4	0.0	0.0	21.4	7.4	0.0
>180	9.9	132.9	61.0	0.0	66.9	4.9	5.0
Total	897.9	1067.3	312.3	237.1	443.0	348.8	312.0

* 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 %		1.1 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.5 %		1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	1.6 %		2.0 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %		1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-		0.4 %	1.3 %	0.6 %
>180	1.5 %		1.6 %	1.3 %	1.6 %
Total	1.6 %		1.5 %	1.4 %	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	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	115	3094	3373	27	98	3035	3006	13	89	3315	3130
Intragrupo y off-shore***	0	0	1439	917	0	0	1187	973	0	0	1851	1505
Otros	115	30	1092	1334	98	27	985	1228	89	13	607	1137
Total	145	145	5624	5624	126	126	5207	5207	102	102	5773	5773

* 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.