

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2019

Fecha de Información: 23 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\$1841.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	252.8	239.5	96.0	128.0	74.5	55.8	69.0
15-35	395.6	759.2	517.8	76.8	111.4	188.8	130.0
36-60	3.9	15.9	4.5	0.0	11.4	3.9	0.0
61-90	153.5	16.4	0.0	140.0	11.4	8.5	5.0
91-180	1.4	7.4	0.0	0.0	7.4	1.4	0.0
>180	195.4	35.0	0.0	161.0	4.0	3.4	31.0
Total	1002.7	1073.4	618.3	505.8	220.1	261.9	235.0

* 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 %	7.8 %	1.3 %	3.9 %
15-35	1.6 %	1.3 %	1.4 %	1.4 %
36-60	-	1.6 %	1.3 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.2 %	1.2 %
91-180	-	1.8 %	1.2 %	1.7 %
>180	1.6 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.6 %	2.9 %	1.4 %	2.1 %

*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**	29	115	3204	3484	28	98	3084	3037	15	92	3455	3279
Intragrupo y off-shore***	0	0	1499	1016	0	0	1220	993	0	0	1871	1514
Otros	115	29	1133	1336	98	28	979	1254	92	15	657	1189
Total	145	145	5835	5835	126	126	5283	5283	107	107	5983	5983

* 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.