

Fecha de Publicación: 28 de enero de 2019

Fecha de Información: 24 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\$1670.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	434.6	275.6	141.5	294.5	72.1	78.1	62.0
15-35	461.8	606.4	349.2	220.5	150.7	134.8	106.5
36-60	6.7	1.1	0.0	0.0	1.1	6.7	0.0
61-90	7.7	10.6	0.0	0.0	10.6	7.7	0.0
91-180	2.3	9.0	1.5	0.0	7.4	2.3	0.0
>180	20.7	18.6	1.4	2.6	1.2	2.1	16.0
Total	933.6	921.2	493.6	517.6	243.1	231.6	184.5

* 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 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.2 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
91-180	-	1.9 %	1.4 %	1.8 %
>180	1.6 %	2.9 %	1.4 %	1.6 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %

*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**	28	117	3290	3509	29	98	3339	3200	15	93	3550	3369
Intragrupo y off-shore***	0	0	1519	1101	0	0	1340	1202	0	0	1872	1514
Otros	117	28	1138	1336	98	29	995	1272	92	15	711	1250
Total	144	144	5946	5946	127	127	5674	5674	107	107	6133	6133

* 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.