

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 18 de diciembre de 2018 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\$1554.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	196.9	204.9	77.0	60.5	10.9	19.4	117.0
15-35	630.6	839.0	425.8	183.5	52.3	86.1	361.0
36-60	48.9	42.4	26.3	21.5	13.6	24.9	2.5
61-90	16.9	9.0	5.0	0.0	4.0	16.9	0.0
91-180	4.9	5.1	0.0	0.0	5.1	4.9	0.0
>180	2.9	33.1	20.0	0.0	13.1	2.9	0.0
Total	901.1	1133.6	554.1	265.5	99.0	155.1	480.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.7 %	5.5 %	2.6 %
36-60	1.5 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.6 %	1.2 %	1.4 %
91-180	-	1.9 %	1.2 %	1.6 %
>180	-	5.6 %	1.1 %	5.3 %
Total	1.7 %	2.0 %	3.9 %	2.4 %

*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

Sector	17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	206	217	5069	5951	27	137	2123	2483	1	47	1731	1828
Intragruppo y off-shore***	0	0	3260	2454	0	0	1246	982	0	0	970	862
Otros	217	206	862	785	137	27	418	322	47	1	149	159
Total	424	424	9191	9191	165	165	3787	3787	49	49	2850	2850

* 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 intragruppo.