

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 19 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\$1633.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	206.3	186.8	84.5	118.5	34.0	19.5	68.3
15-35	494.7	741.5	480.5	232.7	74.4	75.5	186.6
36-60	91.3	80.4	70.0	60.0	10.4	31.3	0.0
61-90	10.1	7.3	0.0	0.0	7.3	10.1	0.0
91-180	52.1	10.4	0.0	50.0	10.4	2.1	0.0
>180	3.4	4.3	0.0	0.0	4.3	3.4	0.0
Total	857.9	1030.6	635.0	461.2	140.7	141.8	254.9

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	198	219	5196	6087	34	137	2195	2534	7	44	1788	1899
Intragruppo y off-shore***	0	0	3335	2548	0	0	1254	1007	0	0	1021	897
Otros	219	198	889	785	137	34	431	339	44	7	148	160
Total	417	417	9420	9420	171	171	3879	3879	50	50	2957	2957

* 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.