

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 20 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\$1928.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	327.2	85.8	18.1	255.5	17.7	21.7	50.0
15-35	485.0	921.8	671.3	126.5	71.6	179.5	179.0
36-60	40.9	103.8	0.0	0.0	103.8	40.9	0.0
61-90	26.2	26.2	0.0	0.0	26.2	26.2	0.0
91-180	10.6	11.2	0.0	0.0	11.2	10.6	0.0
>180	93.9	94.6	7.0	4.2	17.6	19.7	70.0
Total	983.8	1243.4	696.3	386.2	248.1	298.7	299.0

* 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	1.9 %	2.2 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.1 %	1.4 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
Total	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %

*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**	199	226	5387	6095	33	131	2311	2579	7	44	1806	1934
Intragrupa y off-shore***	0	0	3335	2737	0	0	1254	1074	0	0	1039	897
Otros	226	199	895	784	131	33	446	358	44	7	148	161
Total	425	425	9616	9616	164	164	4011	4011	51	51	2993	2993

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