

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 24 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\$154.9 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	26.3	11.8	10.0	26.0	1.8	0.3	0.0
15-35	9.2	92.7	89.5	6.0	3.2	3.2	0.0
36-60	2.0	2.9	0.0	0.0	2.9	2.0	0.0
61-90	0.6	0.2	0.0	0.0	0.2	0.6	0.0
91-180	1.7	7.4	0.0	0.0	7.4	1.7	0.0
>180	0.0	0.2	0.0	0.0	0.2	0.0	0.0
Total	39.8	115.1	99.5	32.0	15.6	7.8	0.0

* 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 %	1.3 %	1.5 %
15-35	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
36-60	-	2.1 %	1.1 %	1.7 %
61-90	-	1.8 %	1.0 %	1.2 %
91-180	-	1.7 %	0.8 %	1.5 %
>180	-	1.6 %	1.6 %	1.6 %
Total	-	2.0 %	1.4 %	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	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	138	2457	2596	7	44	1826	2060	7	87	2616	3550
Intragrupa y off-shore***	0	0	1264	1198	0	0	1143	897	0	0	2246	1059
Otros	138	26	453	380	44	7	152	164	87	7	295	549
Total	164	164	4173	4173	51	51	3121	3121	94	94	5157	5157

* 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.