

Fecha de Publicación: 2 de enero de 2019

Fecha de Información: 27 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\$786.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	65.4	31.5	0.0	14.5	23.5	42.9	8.0
15-35	272.8	252.2	55.0	89.5	67.2	53.4	130.0
36-60	112.0	68.6	45.0	45.0	3.6	47.0	20.0
61-90	15.4	62.5	8.4	0.0	39.0	0.4	15.0
91-180	9.0	30.1	15.0	0.0	15.1	9.0	0.0
>180	6.9	32.5	0.0	0.0	32.5	6.9	0.0
Total	481.6	477.5	123.4	149.0	181.0	159.6	173.0

* 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	2.0 %	2.3 %	1.1 %	1.5 %
15-35	1.7 %	2.1 %	1.5 %	1.8 %
36-60	1.7 %	1.1 %	1.2 %	1.2 %
61-90	1.7 %	1.8 %	0.7 %	1.8 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
>180	-	1.8 %	1.4 %	1.7 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.3 %	1.6 %

*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**	24	138	2492	2664	28	53	1884	2296	15	87	2713	3668
Intragrupa y off-shore***	0	0	1284	1219	0	0	1339	907	0	0	2294	1063
Otros	138	24	479	373	53	28	157	177	87	15	310	586
Total	163	163	4256	4256	81	81	3380	3380	102	102	5317	5317

* 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.