Fecha de Publicación: 9 de enero de 2019

Fecha de Información: 04 de enero de 2019 [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$1213.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	244.5	62.1	0.0	192.5	38.1	28.0	24.0
15-35	401.7	447.0	293.5	295.0	56.5	9.7	97.0
36-60	18.6	15.0	1.0	0.0	14.0	18.6	0.0
61-90	11.3	40.0	0.5	0.0	39.5	11.3	0.0
91-180	0.2	24.0	0.0	0.0	24.0	0.2	0.0
>180	70.0	10.3	0.0	60.0	0.3	0.0	10.0
Total	**746.2**	**598.5**	**295.0**	**547.5**	**172.4**	**67.7**	**131.0**

* 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	1.7 %	2.5 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.5 %	1.6 %	2.0 %
61-90	-	4.0 %	1.4 %	3.4 %
91-180	-	1.8 %	0.4 %	1.8 %
>180	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
Total	1.7 %	2.1 %	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

Sectores	31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero				14 al 18 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	56	2174	2358	22	100	3214	3831	36	124	4471	4534
Intragrupo y off-shore***	0	0	1382	1188	0	0	2379	1515	0	0	2189	1221
Otros	56	25	172	182	100	22	364	611	124	36	1074	1979
Total	**81**	**81**	**3727**	**3727**	**122**	**122**	**5957**	**5957**	**160**	**160**	**7734**	**7734**

* 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.