Fecha de Publicación: 15 de enero de 2019

Fecha de Información: 11 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$1484.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.[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	233.8	236.0	168.5	158.0	21.0	29.2	46.5
15-35	470.9	520.8	303.5	195.5	59.3	117.4	158.0
36-60	9.3	37.1	0.0	0.0	37.1	9.3	0.0
61-90	15.7	40.4	15.0	10.0	25.4	5.7	0.0
91-180	0.4	35.2	0.0	0.0	35.2	0.4	0.0
>180	71.4	38.3	10.0	50.0	8.3	1.4	20.0
Total	**801.4**	**907.8**	**497.0**	**413.5**	**186.3**	**163.4**	**224.5**

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

*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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	7 al 11 de enero				14 al 18 de enero				21 al 25 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	104	3702	3977	41	135	5207	5317	28	99	1861	2434
Intragrupo y off-shore***	0	0	2467	1979	0	0	2452	1572	0	0	1155	418
Otros	104	23	397	608	135	41	1289	2059	99	28	690	854
Total	**127**	**127**	**6565**	**6565**	**176**	**176**	**8948**	**8948**	**127**	**127**	**3706**	**3706**

* 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.