Fecha de Publicación: 29 de enero de 2019

Fecha de Información: 25 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$2583.6 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	296.4	211.3	64.0	138.0	32.3	43.4	115.0
15-35	876.0	820.7	413.6	497.3	83.1	54.7	324.0
36-60	23.8	75.3	60.0	10.9	8.3	5.8	7.0
61-90	21.0	290.7	285.5	16.9	5.2	4.1	0.0
91-180	0.3	11.6	0.0	0.0	11.6	0.3	0.0
>180	380.3	230.2	20.0	150.0	2.2	22.3	208.0
Total	**1597.8**	**1639.8**	**843.1**	**813.1**	**142.7**	**130.7**	**654.0**

* 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	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
36-60	1.6 %	2.9 %	1.3 %	2.0 %
61-90	-	1.4 %	1.5 %	1.4 %
91-180	-	1.7 %	0.8 %	1.7 %
>180	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %

*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	21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	117	3290	3508	29	99	3425	3296	16	92	3760	3480
Intragrupo y off-shore***	0	0	1519	1101	0	0	1396	1244	0	0	1880	1610
Otros	117	28	1137	1336	99	29	1001	1281	91	16	734	1283
Total	**145**	**145**	**5945**	**5945**	**128**	**128**	**5822**	**5822**	**107**	**107**	**6373**	**6373**

* 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.