Fecha de Publicación: 30 de enero de 2019

Fecha de Información: 28 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$1689.8 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	244.8	219.0	111.2	143.5	33.8	27.3	74.0
15-35	738.5	720.7	225.5	177.2	112.2	178.3	383.0
36-60	13.6	14.9	0.0	0.0	14.9	13.6	0.0
61-90	0.6	6.1	3.5	0.0	2.6	0.6	0.0
91-180	62.1	16.7	0.5	50.0	16.2	12.1	0.0
>180	109.2	64.5	0.0	22.7	0.6	22.6	63.9
Total	**1168.8**	**1042.0**	**340.7**	**393.4**	**180.4**	**254.5**	**520.9**

* 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 %	0.7 %	1.4 %	1.2 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	2.2 %	1.5 %	1.9 %
61-90	-	1.8 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.6 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.7 %
Total	1.6 %	1.4 %	1.5 %	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	28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	104	3612	3440	16	92	3814	3547	20	105	4456	3979
Intragrupo y off-shore***	0	0	1495	1379	0	0	1892	1619	0	0	1702	1395
Otros	104	32	1006	1295	92	16	754	1293	105	20	1077	1856
Total	**136**	**136**	**6113**	**6113**	**108**	**108**	**6460**	**6460**	**126**	**126**	**7235**	**7230**

* 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.