

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2019

Fecha de Información: 29 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\$2223.9 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	240.9	199.7	103.0	154.7	35.7	25.2	61.0
15-35	820.5	919.3	473.7	274.5	169.6	270.0	276.0
36-60	50.7	71.0	0.0	0.0	31.0	10.7	40.0
61-90	64.9	41.9	25.0	25.0	6.9	29.9	10.0
91-180	24.2	42.8	0.0	20.0	42.8	4.2	0.0
>180	107.9	103.1	26.1	30.0	1.0	1.9	76.0
Total	1309.1	1377.8	627.8	504.2	287.0	341.9	463.0

* 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 %	1.8 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.7 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.6 %	2.6 %	1.2 %	2.0 %
61-90	1.6 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.7 %
>180	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.7 %	1.5 %	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.

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**	35	95	3918	3664	25	93	3800	3618	29	108	4514	4009
Intragrupo y off-shore***	0	0	1495	1486	0	0	1995	1636	0	0	1752	1429
Otros	95	35	1204	1467	93	25	687	1227	108	29	1037	1860
Total	130	130	6617	6617	118	118	6482	6482	138	138	7303	7298

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