

Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2019

Fecha de Información: 30 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\$2076.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	407.0	314.7	118.5	208.8	46.2	48.2	150.0
15-35	680.6	855.7	385.2	204.1	146.9	152.9	323.6
36-60	11.3	27.7	20.0	0.0	7.7	11.3	0.0
61-90	45.6	66.8	27.5	0.0	25.8	32.1	13.5
91-180	9.3	28.9	0.0	0.0	28.9	9.3	0.0
>180	109.6	26.4	0.0	89.6	6.4	0.0	20.0
Total	1263.4	1320.1	551.2	502.4	261.8	253.9	507.1

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

*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	4220	3826	25	97	3844	3725	29	110	4617	4140
Intragrupo y off-shore***	0	0	1532	1684	0	0	2077	1637	0	0	1802	1439
Otros	95	35	1230	1471	97	25	692	1251	110	29	1045	1880
Total	130	130	6981	6981	122	122	6613	6613	139	139	7464	7459

* 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.