

Fecha de Publicación: 4 de febrero de 2019

Fecha de Información: 31 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\$2546.9 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	499.8	379.6	78.4	219.6	157.7	136.7	143.5
15-35	789.0	650.8	203.3	420.0	152.2	73.7	295.3
36-60	188.0	72.6	0.0	64.8	72.6	123.2	0.0
61-90	28.2	100.2	0.0	20.0	95.2	3.2	5.0
91-180	135.5	89.1	3.1	125.0	76.0	0.5	10.0
>180	30.7	57.2	19.4	10.0	17.8	0.7	20.0
Total	1671.2	1349.5	304.1	859.3	571.5	338.1	473.9

* 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	1.6 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	2.0 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
Total	-	1.7 %	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	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	4260	3919	25	103	4058	3812	34	125	4870	4326
Intragrupo y off-shore***	0	0	1590	1684	0	0	2090	1786	0	0	1809	1510
Otros	95	35	1235	1482	103	25	719	1269	125	34	1151	1984
Total	130	130	7085	7085	129	129	6867	6867	160	160	7831	7821

* 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.