

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2019

Fecha de Información: 01 de febrero 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\$2058.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	286.3	338.2	143.5	159.5	132.2	64.3	62.5
15-35	408.0	544.9	399.0	234.5	60.9	88.5	85.0
36-60	10.6	41.3	5.0	0.0	36.3	10.6	0.0
61-90	232.8	51.2	5.0	115.0	29.7	101.3	16.5
91-180	39.3	60.2	0.2	25.0	59.9	14.3	0.0
>180	155.5	78.9	5.0	129.6	48.9	0.9	25.0
Total	1132.5	1114.6	557.7	663.6	367.9	279.9	189.0

* 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 %	0.8 %	0.7 %	0.8 %
15-35	1.5 %	1.2 %	1.4 %	1.3 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.7 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.2 %	1.3 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.5 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %

*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

Sector	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	94	4260	3920	27	109	4250	3917	35	131	4963	4547
Intragrupa y off-shore***	0	0	1590	1684	0	0	2180	1945	0	0	1863	1510
Otros	94	35	1236	1482	108	27	717	1285	131	35	1273	2032
Total	129	129	7086	7086	136	136	7147	7147	165	165	8099	8089

* 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.