

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2019

Fecha de Información: 05 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\$2734.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	655.3	669.5	282.4	332.0	149.1	85.3	238.0
15-35	605.8	790.1	444.0	264.0	44.6	40.3	301.5
36-60	58.7	38.5	0.0	20.0	18.5	18.7	20.0
61-90	362.6	20.2	0.0	90.0	10.2	262.6	10.0
91-180	18.1	10.5	0.0	0.0	10.5	18.1	0.0
>180	58.9	65.8	11.4	0.0	4.4	8.9	50.0
Total	1759.3	1594.6	737.8	706.0	237.3	433.8	619.5

* 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	1.3 %	0.8 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.3 %	1.2 %	0.9 %	1.2 %
36-60	1.4 %	1.9 %	1.2 %	1.5 %
61-90	1.6 %	4.2 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.9 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
Total	1.4 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	106	4929	4424	35	129	5292	4935	26	150	2531	3328
Intragrupo y off-shore***	0	0	2322	2260	0	0	2064	1692	0	0	1613	908
Otros	106	29	961	1528	129	35	1307	2026	150	26	820	728
Total	136	136	8212	8212	165	165	8663	8653	176	176	4965	4965

* 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.