

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2019

Fecha de Información: 06 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\$2223.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	340.2	536.6	350.8	86.0	69.9	138.2	116.0
15-35	854.6	662.5	310.0	336.0	112.8	278.9	239.7
36-60	6.3	4.7	0.4	0.0	4.3	6.3	0.0
61-90	83.6	45.4	1.3	80.0	44.2	3.6	0.0
91-180	31.1	12.5	5.0	29.0	7.5	2.1	0.0
>180	0.6	0.8	0.0	0.0	0.8	0.6	0.0
Total	1316.5	1262.5	667.4	531.0	239.4	429.8	355.7

* 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 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.1 %	1.0 %	1.4 %
61-90	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
>180	-	2.2 %	1.5 %	1.9 %
Total	1.5 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %

*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	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	101	5010	4700	35	132	5501	5184	26	150	2598	3351
Intragrupo y off-shore***	0	0	2533	2260	0	0	2202	1778	0	0	1617	908
Otros	101	29	969	1551	132	35	1359	2090	150	26	829	785
Total	130	130	8512	8512	168	168	9062	9052	177	177	5044	5044

* 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.