

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2019

Fecha de Información: 07 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\$1954.5 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	347.4	476.0	320.0	171.0	19.5	39.9	136.5
15-35	478.2	604.8	411.5	200.0	44.8	129.7	148.5
36-60	29.3	21.4	0.0	22.6	21.4	6.7	0.0
61-90	22.4	52.6	0.0	0.0	32.6	2.4	20.0
91-180	122.5	44.5	0.0	100.0	24.5	2.5	20.0
>180	25.6	59.8	48.4	19.0	6.4	1.6	5.0
Total	1025.4	1259.1	779.9	512.6	149.2	182.8	330.0

* 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	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.6 %	1.4 %	2.3 %
61-90	1.4 %	1.8 %	1.2 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.7 %
Total	1.4 %	1.6 %	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.

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	100	5033	4728	36	134	5709	5533	27	152	2718	3476
Intragruppo y off-shore***	0	0	2545	2271	0	0	2447	1858	0	0	1705	988
Otros	100	29	973	1552	134	36	1368	2123	152	27	836	795
Total	129	129	8551	8551	169	169	9524	9514	179	179	5259	5259

* 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.