

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2019

Fecha de Información: 08 de febrero de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1472.0 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	192.4	518.8	417.0	95.0	12.8	8.4	89.0
15-35	555.8	338.3	132.2	299.5	64.1	114.3	142.0
36-60	1.1	6.8	0.0	0.0	6.8	1.1	0.0
61-90	41.3	10.7	0.0	30.0	5.7	6.3	5.0
91-180	5.8	22.1	0.3	0.0	21.8	5.8	0.0
>180	10.6	14.1	0.0	0.0	4.1	0.6	10.0
Total	807.1	910.9	549.5	424.5	115.4	136.6	246.0

* 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 %		1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.5 %		1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-		2.6 %	0.6 %	2.3 %
61-90	1.5 %		1.7 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-		2.2 %	1.4 %	2.0 %
>180	1.6 %		1.9 %	1.1 %	1.7 %
Total	1.4 %		1.4 %	1.3 %	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	5033	4728	36	140	5897	5915	28	151	2721	3607
Intragrupo y off-shore***	0	0	2545	2271	0	0	2736	1953	0	0	1833	988
Otros	101	29	973	1552	140	36	1372	2127	151	28	839	798
Total	130	130	8551	8551	176	176	10005	9995	179	179	5393	5393

* 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.