

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2019

Fecha de Información: 12 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\$1822.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	249.3	373.1	168.8	73.5	85.1	56.6	119.2
15-35	781.6	619.1	219.0	107.8	43.6	317.3	356.5
36-60	214.8	127.7	0.0	50.0	18.7	55.8	109.0
61-90	1.3	2.7	0.0	0.0	2.7	1.3	0.0
91-180	3.2	17.4	0.0	0.0	17.4	3.2	0.0
>180	13.1	3.5	0.0	10.0	3.5	3.1	0.0
Total	1263.3	1143.4	387.8	241.3	170.9	437.3	584.7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	0.9 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	2.2 %	1.9 %	1.9 %
Total	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %

*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	11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	163	6325	6143	28	162	2796	3832	18	189	5329	5617
Intragruppo y off-shore***	0	0	2827	2218	0	0	1946	990	0	0	2791	2306
Otros	163	39	1361	2142	162	28	929	849	189	18	782	979
Total	201	201	10513	10503	191	191	5671	5671	207	207	8902	8902

* 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 intragruppo.