

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2019

Fecha de Información: 13 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\$2002.8 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	252.9	149.9	77.5	137.0	54.4	97.9	18.0
15-35	770.4	915.6	401.5	84.1	82.1	254.3	432.0
36-60	263.4	54.2	12.8	10.0	31.4	243.4	10.0
61-90	23.3	10.3	0.0	0.0	0.3	13.3	10.0
91-180	11.1	10.8	0.0	2.2	10.8	8.9	0.0
>180	9.1	9.7	0.0	0.0	1.7	1.1	8.0
Total	1330.1	1150.7	491.8	233.3	180.9	618.8	478.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	1.7 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	1.5 %	2.2 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-	2.1 %	1.5 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.2 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.4 %	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	166	6427	6211	30	162	2872	3862	18	189	5452	5742
Intragruppo y off-shore***	0	0	2880	2307	0	0	1965	1038	0	0	2836	2317
Otros	166	39	1366	2145	162	30	941	877	189	18	816	1046
Total	205	205	10674	10664	192	192	5778	5778	207	207	9105	9105

* 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 intragruppo.