

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2019

Fecha de Información: 14 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\$2300.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	238.7	172.1	106.0	160.4	61.1	73.4	5.0
15-35	748.8	1182.5	708.9	244.5	106.4	137.0	367.3
36-60	15.5	45.5	0.0	0.0	45.5	15.5	0.0
61-90	44.3	16.1	5.0	17.0	1.1	17.3	10.0
91-180	36.7	27.9	10.0	10.0	12.9	21.7	5.0
>180	85.5	118.9	70.0	35.0	3.9	5.5	45.0
Total	1169.5	1563.1	899.9	466.9	230.9	270.3	432.3

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.5 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.6 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
Total	1.7 %	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	166	6578	6245	30	162	2910	3898	18	188	5508	5904
Intragruo y off-shore***	0	0	2899	2436	0	0	1968	1058	0	0	2978	2339
Otros	166	39	1381	2167	162	30	973	896	188	18	830	1074
Total	205	205	10858	10848	192	192	5852	5852	206	206	9316	9316

* 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 intragruo.