

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1307.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	275.6	138.6	73.3	223.3	35.4	22.3	30.0
15-35	405.0	559.5	255.0	136.5	62.5	26.5	242.0
36-60	0.9	51.8	0.0	0.0	51.8	0.9	0.0
61-90	8.7	9.0	0.0	0.0	9.0	8.7	0.0
91-180	0.1	43.2	0.0	0.0	43.2	0.1	0.0
>180	80.1	32.2	2.2	50.0	5.0	5.1	25.0
Total	770.4	834.2	330.4	409.8	206.8	63.6	297.0

* 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	1.9 %	1.4 %	1.5 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.9 %	1.2 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	1.3 %	1.7 %
91-180	-	2.1 %	1.4 %	2.1 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.7 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %

*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	165	3127	3996	18	188	5565	5941
Intragruppo y off-shore***	0	0	2899	2436	0	0	2040	1252	0	0	2980	2368
Otros	166	39	1381	2167	165	30	990	909	188	18	846	1083
Total	205	205	10858	10848	195	195	6156	6156	206	206	9391	9391

* 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.