

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2019

Fecha de Información: 19 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\$1988.5 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	304.4	341.9	208.0	145.5	33.9	58.9	100.0
15-35	572.9	650.6	249.3	189.3	107.9	90.1	293.5
36-60	66.8	40.8	0.0	30.0	20.8	16.8	20.0
61-90	126.3	93.0	0.0	50.0	93.0	76.3	0.0
91-180	21.8	93.9	0.3	0.0	73.5	1.8	20.0
>180	50.3	89.3	50.0	10.0	9.3	10.3	30.0
Total	1142.5	1309.5	507.6	424.8	338.4	254.2	463.5

* 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	1.8 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.6 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.8 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
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	18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	132	3395	4126	18	188	5662	6204	10	89	3667	3533
Intragruppo y off-shore***	0	0	2052	1412	0	0	3176	2400	0	0	1571	1257
Otros	132	31	1013	922	188	18	873	1108	89	10	517	965
Total	163	163	6460	6460	206	206	9712	9712	99	99	5755	5755

* 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.