

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1521.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	417.1	360.0	68.0	154.5	59.0	29.6	233.0
15-35	297.4	352.7	211.9	99.3	32.2	89.6	108.6
36-60	0.3	12.2	0.0	0.0	12.2	0.3	0.0
61-90	212.4	159.0	0.0	66.5	14.0	0.9	145.0
91-180	19.0	45.9	19.4	8.8	26.5	10.2	0.0
>180	75.2	127.0	20.0	0.0	37.0	5.2	70.0
Total	1021.4	1056.6	319.2	329.0	180.8	135.8	556.6

* 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	2.0 %	2.0 %	1.2 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	2.1 %
61-90	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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**	30	131	3703	4283	20	210	6118	6800	10	89	3899	3856
Intragruppo y off-shore***	0	0	2125	1632	0	0	3465	2597	0	0	1732	1317
Otros	131	30	1029	941	210	20	993	1180	89	10	575	1034
Total	160	160	6857	6857	230	230	10577	10577	99	99	6207	6207

* 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.