

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2019

Fecha de Información: 25 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\$1691.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	445.5	246.7	125.8	319.2	31.9	37.3	89.0
15-35	396.3	412.5	253.9	159.8	43.6	121.5	115.0
36-60	104.7	103.9	0.0	0.0	91.9	92.7	12.0
61-90	58.8	69.5	0.0	0.0	64.5	53.8	5.0
91-180	0.2	55.5	0.0	0.0	55.5	0.2	0.0
>180	4.2	14.9	3.6	0.0	11.3	4.2	0.0
Total	1009.6	903.0	383.3	479.0	298.7	309.7	221.0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	218	6482	6944	11	90	3945	3927	9	129	3454	4033
Intragruppo y off-shore***	0	0	3566	2894	0	0	1755	1324	0	0	1905	726
Otros	218	20	994	1203	90	11	592	1042	129	9	882	1481
Total	237	237	11042	11042	101	101	6292	6292	138	138	6241	6241

* 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.