

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2019

Fecha de Información: 26 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\$2520.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	492.4	301.0	174.5	380.6	54.7	40.0	71.8
15-35	566.2	713.0	450.1	214.0	73.5	162.8	189.4
36-60	190.0	70.8	2.7	39.9	58.1	140.0	10.0
61-90	0.3	15.6	2.0	0.0	13.6	0.3	0.0
91-180	177.2	173.8	1.0	55.0	97.8	47.2	75.0
>180	116.0	166.7	7.0	0.0	43.7	0.0	116.0
Total	1542.1	1440.8	637.2	689.5	341.4	390.4	462.2

* 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	2.1 %	2.4 %	0.7 %	1.4 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
36-60	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.1 %	1.5 %	2.1 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.9 %	1.9 %	-	1.9 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.4 %	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	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**	19	204	6889	7051	17	93	4012	4128	18	131	3544	4176
Intragrupo y off-shore***	0	0	3601	3251	0	0	1895	1347	0	0	2032	726
Otros	204	19	1014	1203	93	17	633	1065	131	18	897	1571
Total	223	223	11504	11504	109	109	6541	6541	150	150	6474	6474

* 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 intragrupo.