

Fecha de Publicación: 1 de marzo de 2019

Fecha de Información: 27 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\$2441.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	297.5	296.4	89.4	175.5	172.0	87.0	35.0
15-35	592.0	645.7	363.5	287.0	136.4	159.2	145.8
36-60	154.4	57.5	0.0	0.0	57.5	154.4	0.0
61-90	107.0	47.2	0.0	0.0	37.2	97.0	10.0
91-180	211.1	103.0	22.7	60.0	74.9	145.7	5.4
>180	80.4	120.9	0.0	0.0	45.9	5.4	75.0
Total	1442.5	1270.6	475.6	522.5	523.8	648.8	271.2

* 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	1.8 %	1.1 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.7 %	2.2 %	1.6 %	1.8 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %

* 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**	20	198	7053	7149	18	96	4082	4200	19	133	3624	4311
Intragrupo y off-shore***	0	0	3686	3406	0	0	1897	1368	0	0	2034	726
Otros	198	20	1020	1205	96	18	675	1086	133	19	1020	1641
Total	218	218	11759	11759	114	114	6655	6655	152	152	6678	6678

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