Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2019

Fecha de Información: 21 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$2115.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[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	248.2	444.1	327.3	137.0	89.8	84.2	27.0
15-35	418.6	696.7	287.3	239.7	260.5	30.0	149.0
36-60	26.0	16.5	0.0	0.0	11.5	21.0	5.0
61-90	264.4	66.2	0.0	3.0	61.2	256.4	5.0
91-180	47.1	8.3	1.4	40.0	6.9	7.1	0.0
>180	34.1	39.6	22.0	10.0	9.6	16.1	8.0
Total	**1038.4**	**1271.5**	**638.0**	**429.7**	**439.5**	**414.8**	**194.0**

* 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	1.8 %	1.1 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.9 %	1.1 %	1.4 %	1.3 %
36-60	1.9 %	2.6 %	1.2 %	1.8 %
61-90	1.7 %	1.7 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.9 %	1.2 %	1.3 %	1.3 %

*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	203	5828	6573	10	91	3775	3729
Intragrupo y off-shore***	0	0	2125	1632	0	0	3430	2474	0	0	1699	1285
Otros	131	30	1029	941	203	20	959	1171	91	10	557	1016
Total	**161**	**161**	**6857**	**6857**	**223**	**223**	**10217**	**10217**	**101**	**101**	**6031**	**6031**

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