

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2019

Fecha de Información: 28 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\$2073.4 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	507.0	461.4	207.4	260.0	47.0	40.0	207.0
15-35	592.7	740.8	409.3	249.6	110.6	122.2	221.0
36-60	13.3	13.2	0.0	0.0	13.2	13.3	0.0
61-90	2.6	12.0	0.0	0.0	12.0	2.6	0.0
91-180	16.8	67.4	3.3	15.7	63.5	0.5	0.6
>180	48.6	61.4	0.0	0.0	26.4	13.6	35.0
Total	1180.9	1356.1	619.9	525.2	272.5	192.1	463.6

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.7 %	0.8 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.1 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.9 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.3 %	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**	21	190	7263	7258	18	97	4231	4442	19	136	3799	4429
Intragrupo y off-shore***	0	0	3759	3587	0	0	2011	1387	0	0	2054	806
Otros	190	21	1036	1214	97	18	703	1116	136	19	1032	1649
Total	211	211	12058	12058	115	115	6945	6945	154	154	6885	6885

* 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.