

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2019

Fecha de Información: 01 de marzo 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\$1563.2 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	314.3	356.1	171.7	138.7	23.4	14.7	161.0
15-35	482.9	682.3	363.9	162.6	29.9	31.8	288.5
36-60	3.2	46.2	0.0	0.0	46.2	3.2	0.0
61-90	55.5	47.6	20.0	30.0	16.6	14.5	11.0
91-180	1.3	17.2	0.0	0.0	17.2	1.3	0.0
>180	5.6	16.3	0.0	0.0	11.3	0.6	5.0
Total	862.9	1165.8	555.5	331.2	144.8	66.1	465.5

* 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 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.9 %	1.3 %	1.8 %
61-90	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	1.9 %	1.0 %	1.9 %
>180	1.7 %	2.1 %	0.6 %	1.9 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.5 %	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**	21	189	7262	7259	18	104	4396	4646	19	137	3949	4573
Intragrupo y off-shore***	0	0	3759	3587	0	0	2150	1491	0	0	2087	841
Otros	189	21	1037	1213	104	18	718	1127	137	19	1032	1653
Total	210	210	12058	12058	122	122	7265	7265	155	155	7068	7068

* 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.