

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2019

Fecha de Información: 04 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\$1801.8 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	504.9	417.4	99.0	178.4	38.4	46.5	280.0
15-35	544.4	581.7	303.0	146.3	37.8	157.2	241.0
36-60	82.9	50.7	20.0	0.0	30.7	82.9	0.0
61-90	9.7	46.2	0.0	0.0	46.2	9.7	0.0
91-180	7.2	15.0	0.0	3.5	11.5	0.2	3.5
>180	29.8	36.3	0.0	4.8	36.3	25.0	0.0
Total	1179.0	1147.3	421.9	333.0	200.9	321.5	524.5

* 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 %	1.6 %	1.1 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
91-180	1.7 %	2.0 %	1.4 %	1.9 %
>180	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.7 %	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	4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	107	4664	4776	19	138	4187	4833	27	137	2962	3962
Intragrupo y off-shore***	0	0	2203	1669	0	0	2113	841	0	0	2375	1279
Otros	107	18	715	1137	138	19	1066	1691	137	27	493	588
Total	125	125	7582	7582	157	157	7365	7365	164	164	5830	5830

* 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.