

Fecha de Publicación: 8 de marzo de 2019

Fecha de Información: 06 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\$1726.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	294.6	308.6	79.0	116.0	107.9	56.9	121.7
15-35	518.0	496.7	200.5	217.8	86.2	90.2	210.0
36-60	0.4	2.4	0.0	0.0	2.4	0.4	0.0
61-90	82.9	153.5	60.0	10.0	60.0	39.4	33.5
91-180	46.9	35.7	23.0	0.0	12.7	46.9	0.0
>180	77.0	115.5	74.1	32.2	1.4	4.8	40.0
Total	1019.8	1112.3	436.5	376.0	270.5	238.6	405.2

* 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 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.1 %	1.4 %	2.0 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	1.8 %	1.7 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.7 %	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	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	111	4821	4903	19	139	4338	4996	29	141	3140	4115
Intragruppo y off-shore***	0	0	2304	1818	0	0	2163	895	0	0	2385	1309
Otros	111	18	734	1139	139	19	1129	1738	141	29	529	630
Total	129	129	7860	7860	158	158	7630	7630	170	170	6054	6054

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