

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2019

Fecha de Información: 12 de marzo de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2235.4 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	570.4	311.5	160.8	442.5	79.6	56.8	71.1
15-35	539.9	1057.9	704.5	87.3	37.4	136.7	316.0
36-60	19.0	5.2	0.0	0.0	5.2	19.0	0.0
61-90	1.7	9.8	0.0	0.0	9.8	1.7	0.0
91-180	35.8	26.4	10.0	10.0	6.4	15.8	10.0
>180	48.3	6.6	0.0	40.0	6.6	8.3	0.0
Total	1215.1	1417.4	875.3	579.8	145.0	238.2	397.1

* 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	
3-14	2.0 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.7 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	3.1 %	1.5 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.1 %	1.9 %
91-180	1.7 %	2.3 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	2.0 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.7 %	1.9 %	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.

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) $^{\wedge}$ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Nota: Debido a inconsistencias en la información del 12 de marzo de 2019 se retransmiten los informes de los días 12, 13, 14 y 15 de marzo de 2019.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	144	5333	5576	28	139	3655	4932	19	185	2001	2468
Intragrupo y off-shore***	0	0	2436	1650	0	0	2867	1497	0	0	1215	772
Otros	144	20	1241	1784	139	28	655	748	185	19	655	631
Total	165	165	9010	9010	168	168	7177	7177	204	204	3871	3871

* 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.