

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2019

Fecha de Información: 13 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\$1913.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	320.1	155.7	24.3	192.8	21.4	17.3	110.0
15-35	714.8	553.2	343.0	162.0	63.2	405.8	147.0
36-60	25.1	21.6	0.0	0.0	1.6	5.1	20.0
61-90	200.5	134.2	90.4	0.1	38.8	195.3	5.0
91-180	7.6	23.7	12.0	0.0	11.7	7.6	0.0
>180	30.5	28.9	0.0	10.0	8.9	0.5	20.0
Total	1298.6	917.3	469.7	364.9	145.6	631.7	302.0

* 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	2.0 %	2.5 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
36-60	1.8 %	3.2 %	1.7 %	1.9 %
61-90	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	1.9 %	1.0 %	1.5 %
>180	1.8 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	145	5679	5678	29	145	4546	5580	24	189	2216	2588
Intragrupo y off-shore***	0	0	2446	1913	0	0	3084	1975	0	0	1226	864
Otros	145	20	1254	1788	145	29	739	815	189	24	698	688
Total	165	165	9379	9379	173	173	8369	8369	214	214	4141	4141

* 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.