

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2019

Fecha de Información: 14 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\$2999.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	844.6	545.4	199.0	500.0	47.4	45.6	299.0
15-35	557.4	955.7	744.5	327.5	21.2	39.9	190.0
36-60	33.4	173.4	161.0	23.8	3.4	0.6	9.0
61-90	30.6	57.6	30.0	20.0	17.6	0.6	10.0
91-180	131.3	104.8	25.0	50.0	24.8	26.3	55.0
>180	124.9	83.8	0.0	30.0	3.8	14.9	80.0
Total	1722.1	1920.6	1159.5	951.3	118.1	127.8	643.0

* 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	2.2 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	1.6 %	2.2 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
91-180	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.7 %	2.3 %	1.8 %	1.8 %
Total	2.1 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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
Intragruppo 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.