

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1380.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	121.4	204.6	148.0	70.7	36.6	30.7	20.0
15-35	342.4	507.6	364.0	131.8	50.6	117.6	93.0
36-60	51.4	8.3	0.0	0.0	8.3	51.4	0.0
61-90	2.1	116.7	80.0	0.0	36.7	2.1	0.0
91-180	81.1	12.1	0.0	70.0	12.1	11.1	0.0
>180	37.7	33.4	4.3	10.0	4.1	2.7	25.0
Total	636.0	882.7	596.3	282.4	148.4	215.6	138.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.7 %	2.2 %	1.4 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	1.9 %	1.4 %	1.9 %
91-180	-	2.2 %	1.4 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.2 %	1.5 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %

*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	18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	186	5306	5870	25	140	2408	2987	5	112	3115	3645
Intragruo y off-shore***	0	0	3200	2559	0	0	1520	964	0	0	1889	995
Otros	186	30	791	868	140	25	783	760	112	5	298	662
Total	216	216	9297	9297	165	165	4710	4710	117	117	5302	5302

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.