Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2019

Fecha de Información: 07 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$1764.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.[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	272.4	325.2	213.5	208.5	67.2	19.4	44.5
15-35	299.8	694.4	507.8	93.6	32.6	52.1	154.0
36-60	4.8	7.3	0.0	0.0	7.3	4.8	0.0
61-90	177.6	189.8	10.0	0.0	51.8	49.6	128.0
91-180	23.2	56.5	51.1	0.0	5.5	23.2	0.0
>180	35.1	19.5	0.0	10.0	4.5	10.1	15.0
Total	**812.9**	**1292.7**	**782.3**	**312.1**	**168.9**	**159.3**	**341.5**

* 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 %	2.2 %	1.6 %	2.0 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	4.9 %	1.3 %	3.4 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
Total	1.8 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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	109	4957	4962	19	139	4397	5194	29	142	3232	4229
Intragrupo y off-shore***	0	0	2344	1951	0	0	2327	915	0	0	2430	1372
Otros	109	18	749	1138	139	19	1133	1747	142	29	577	639
Total	**127**	**127**	**8051**	**8051**	**158**	**158**	**7856**	**7856**	**171**	**171**	**6239**	**6239**

* 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 intragrupo.