Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2019

Fecha de Información: 08 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$2118.5 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	490.5	392.6	145.0	220.0	50.6	73.5	197.0
15-35	465.8	744.2	534.0	164.5	100.2	191.3	110.0
36-60	32.4	37.9	0.0	0.0	37.9	32.4	0.0
61-90	11.7	85.9	80.0	0.0	5.9	11.7	0.0
91-180	59.1	19.8	13.4	0.0	6.4	59.1	0.0
>180	74.0	56.5	10.0	24.0	1.5	5.0	45.0
Total	**1133.5**	**1337.0**	**782.4**	**408.5**	**202.6**	**373.0**	**352.0**

* 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 %	2.1 %	1.5 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
36-60	-	6.7 %	1.5 %	4.3 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	1.6 %	1.6 %	1.6 %
>180	1.8 %	1.5 %	1.7 %	1.8 %
Total	1.9 %	2.3 %	1.6 %	2.0 %

*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	106	4957	4963	20	148	4751	5421	30	142	3367	4397
Intragrupo y off-shore***	0	0	2344	1951	0	0	2402	1116	0	0	2500	1391
Otros	106	18	750	1138	148	20	1161	1776	142	30	603	681
Total	**124**	**124**	**8052**	**8052**	**168**	**168**	**8313**	**8313**	**172**	**172**	**6469**	**6469**

* 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.