Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2019

Fecha de Información: 11 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$2274.7 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	292.6	271.6	130.5	156.0	37.1	32.6	104.0
15-35	604.4	1071.8	713.8	124.5	65.8	187.7	292.3
36-60	79.4	112.5	90.0	0.0	2.5	59.4	20.0
61-90	111.7	4.8	0.0	0.0	4.8	111.7	0.0
91-180	63.8	81.1	56.4	30.0	14.7	23.8	10.0
>180	4.4	3.4	1.0	0.0	1.9	3.8	0.6
Total	**1156.2**	**1545.3**	**991.6**	**310.5**	**126.9**	**418.9**	**426.9**

* 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	1.9 %	1.7 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.6 %
91-180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.7 %	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	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	149	4882	5515	30	142	3526	4589	19	182	1859	2388
Intragrupo y off-shore***	0	0	2422	1217	0	0	2610	1446	0	0	1167	676
Otros	149	20	1211	1782	142	30	604	706	182	19	651	613
Total	**169**	**169**	**8515**	**8515**	**172**	**172**	**6741**	**6741**	**201**	**201**	**3677**	**3677**

* 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.