

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2019

Fecha de Información: 27 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\$2170.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	206.1	416.8	134.5	139.0	274.1	58.9	8.2
15-35	398.3	725.1	554.5	114.3	36.9	150.3	133.7
36-60	227.3	15.1	0.0	0.4	15.1	226.9	0.0
61-90	46.3	26.5	0.0	40.1	26.5	6.2	0.0
91-180	100.6	89.1	0.0	20.0	59.1	50.6	30.0
>180	69.0	27.2	10.0	50.0	12.2	14.0	5.0
Total	1047.6	1299.9	699.0	363.9	424.0	506.8	176.9

* 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	2.4 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
15-35	2.4 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
36-60	-	2.2 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	4.4 %	2.4 %
91-180	1.9 %	6.4 %	1.8 %	3.6 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
Total	2.3 %	2.3 %	1.8 %	2.1 %

* 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	25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril				8 al 12 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	150	2899	3251	12	109	3219	3879	54	114	4504	4623
Intragrupa y off-shore***	0	0	1737	1404	0	0	2013	1030	0	0	2596	1195
Otros	150	23	799	780	109	12	383	706	114	54	900	2182
Total	174	174	5435	5435	121	121	5615	5615	168	168	8000	8000

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.