

Fecha de Publicación: 1 de abril de 2019

Fecha de Información: 28 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\$3006.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	398.7	582.0	30.0	239.9	432.0	38.8	120.0
15-35	618.7	819.0	400.5	222.8	142.0	119.4	276.5
36-60	468.7	110.0	47.0	0.0	23.0	428.7	40.0
61-90	39.5	74.3	41.0	2.7	30.6	34.1	2.7
91-180	47.1	167.8	30.0	0.0	127.8	37.1	10.0
>180	98.5	91.0	0.0	2.0	31.0	36.5	60.0
Total	1671.1	1844.1	548.5	467.4	786.4	694.5	509.2

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %	1.2 %	2.1 %	1.6 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	2.2 %	2.3 %	1.8 %	1.9 %
61-90	2.0 %	2.2 %	2.4 %	2.3 %
91-180	1.9 %	5.7 %	1.9 %	4.9 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
Total	2.2 %	2.4 %	2.0 %	2.2 %

*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	151	2958	3261	17	107	3411	4015	54	113	4646	5065
Intragruppo y off-shore***	0	0	1741	1468	0	0	2030	1106	0	0	2607	1295
Otros	151	23	805	776	107	17	407	727	113	54	1305	2199
Total	174	174	5505	5505	125	125	5848	5848	168	168	8558	8558

* 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 intragruppo.