

Fecha de Publicación: 2 de abril de 2019

Fecha de Información: 29 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\$1474.8 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	255.1	169.3	34.5	121.0	39.8	39.1	95.0
15-35	571.4	589.4	206.5	138.7	77.5	127.2	305.5
36-60	7.8	42.5	0.7	0.0	41.8	7.8	0.0
61-90	46.3	30.4	0.0	0.0	20.4	36.3	10.0
91-180	2.2	33.9	0.0	0.0	33.9	2.2	0.0
>180	51.4	120.4	0.0	7.0	85.4	9.4	35.0
Total	934.3	986.0	241.6	266.7	298.8	222.2	445.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.2 %	2.4 %	1.8 %	2.1 %
36-60	-	2.8 %	1.9 %	2.6 %
61-90	1.9 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	1.7 %	2.1 %
>180	1.8 %	3.2 %	1.8 %	2.7 %
Total	2.1 %	2.5 %	1.9 %	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

Sector	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**	24	151	2958	3263	25	92	3556	4123	54	118	4750	5120
Intragruppo y off-shore***	0	0	1741	1468	0	0	2063	1187	0	0	2609	1335
Otros	151	24	807	776	92	25	419	728	118	54	1326	2231
Total	174	174	5507	5507	117	117	6038	6038	172	172	8686	8686

* 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.