

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2019

Fecha de Información: 01 de abril 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\$2037.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	508.8	345.7	137.5	319.6	37.2	18.2	171.0
15-35	617.8	643.6	399.0	417.3	110.9	66.8	133.8
36-60	42.7	77.1	52.0	0.0	5.0	22.7	20.0
61-90	21.2	29.2	0.0	4.0	29.2	17.2	0.0
91-180	0.3	19.7	0.0	0.0	19.7	0.3	0.0
>180	20.0	45.7	25.0	10.0	10.7	0.0	10.0
Total	1210.9	1161.0	613.5	750.9	212.7	125.2	334.8

* 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	2.2 %	2.2 %	1.5 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %	1.9 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.1 %	1.1 %	1.7 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.9 %
>180	1.8 %	1.9 %	-	1.9 %
Total	2.1 %	2.1 %	1.8 %	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

Sector	1 al 5 de abril				8 al 12 de abril				15 al 19 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	94	3921	4289	54	118	4897	5297	53	101	2607	3538
Intragruppo y off-shore***	0	0	2147	1465	0	0	2662	1377	0	0	2285	1283
Otros	94	25	423	737	118	54	1358	2242	101	53	206	276
Total	119	119	6491	6491	173	173	8917	8917	154	154	5097	5097

* 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.