

Fecha de Publicación: 4 de abril de 2019

Fecha de Información: 02 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\$1737.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	459.8	384.2	42.8	221.0	107.8	5.2	233.7
15-35	544.9	584.3	201.0	114.8	42.3	89.2	341.0
36-60	247.0	91.4	0.0	10.0	9.9	155.5	81.5
61-90	2.3	18.0	0.0	0.0	18.0	2.3	0.0
91-180	18.2	17.8	0.0	10.0	12.8	3.2	5.0
>180	29.8	21.3	0.0	9.6	1.3	0.2	20.0
Total	1302.0	1117.0	243.8	365.4	192.1	255.5	681.2

* 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	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.4 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.2 %	1.0 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.2 %	1.9 %	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

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**	26	96	4085	4452	54	117	5110	5508	53	101	2687	3550
Intragruppo y off-shore***	0	0	2184	1506	0	0	2666	1487	0	0	2287	1353
Otros	96	26	426	736	117	54	1464	2246	101	53	206	276
Total	122	122	6694	6694	171	171	9240	9240	154	154	5179	5179

* 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.