

Fecha de Publicación: 5 de abril de 2019

Fecha de Información: 03 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\$1464.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	475.9	344.4	79.0	235.9	66.4	41.0	199.0
15-35	337.8	542.4	308.0	125.0	113.4	91.8	121.0
36-60	25.1	10.2	2.4	0.0	7.8	25.1	0.0
61-90	15.6	21.8	0.0	0.0	11.8	5.6	10.0
91-180	1.0	15.6	0.0	0.0	15.6	1.0	0.0
>180	2.9	1.2	0.0	0.0	1.2	2.9	0.0
Total	858.4	935.6	389.4	360.9	216.2	167.5	330.0

* 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 %	1.7 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	2.0 %	2.1 %
61-90	1.9 %	2.1 %	3.4 %	2.3 %
91-180	-	2.2 %	8.1 %	2.6 %
>180	-	2.3 %	1.5 %	1.7 %
Total	2.1 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %

*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		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	26	97	4364	4577	58	122	5302	5718	53	103	2690	3551						
Intragruppo y off-shore***	0	0	2236	1720	0	0	2693	1509	0	0	2287	1353						
Otros	97	26	433	737	122	58	1514	2282	103	53	206	279						
Total	124	124	7034	7034	181	181	9509	9509	156	156	5182	5182						

* 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 intragruppo.