

Fecha de Publicación: 8 de abril de 2019

Fecha de Información: 04 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\$1193.2 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	221.0	183.6	107.2	145.0	16.5	16.0	60.0
15-35	356.2	448.2	300.0	92.0	46.7	162.7	101.5
36-60	6.0	2.9	0.0	0.0	2.9	6.0	0.0
61-90	15.8	25.8	20.0	0.0	5.8	15.8	0.0
91-180	2.5	8.0	0.0	0.0	8.0	2.5	0.0
>180	80.8	39.9	0.0	40.0	3.9	4.8	36.0
Total	682.3	708.4	427.2	277.0	83.8	207.8	197.5

* 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	2.2 %	2.4 %	1.7 %	2.1 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.2 %	1.7 %	1.9 %
61-90	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	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**	27	94	4392	4588	59	123	5424	5845	53	103	2760	3601
Intragruppo y off-shore***	0	0	2237	1750	0	0	2774	1584	0	0	2312	1393
Otros	94	27	444	734	123	59	1519	2289	103	53	211	289
Total	121	121	7073	7073	182	182	9718	9718	156	156	5283	5283

* 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.