

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2019

Fecha de Información: 05 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\$1304.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	328.5	281.3	135.0	196.9	30.8	16.2	115.5
15-35	346.5	454.1	252.5	110.6	77.2	111.6	124.3
36-60	75.3	72.6	0.0	0.0	14.6	17.3	58.0
61-90	3.1	11.0	4.9	0.0	6.2	3.1	0.0
91-180	0.3	15.4	0.0	0.0	15.4	0.3	0.0
>180	1.2	13.1	0.0	0.0	13.1	1.2	0.0
Total	755.0	847.5	392.4	307.5	157.3	149.7	297.8

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.6 %	2.0 %	2.3 %
36-60	2.0 %	3.1 %	2.0 %	2.2 %
61-90	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	1.0 %	2.1 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	2.1 %
Total	2.1 %	2.5 %	2.0 %	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	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	93	4392	4588	59	127	5700	6054	53	104	2812	3669
Intragrupa y off-shore***	0	0	2237	1750	0	0	2858	1744	0	0	2363	1429
Otros	93	27	444	734	126	59	1546	2305	104	53	212	289
Total	120	120	7073	7073	185	185	10104	10104	158	158	5387	5387

* 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 intragrupo.