

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2019

Fecha de Información: 08 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\$2086.1 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	629.7	271.9	50.6	464.0	68.8	13.2	152.5
15-35	487.7	765.0	502.0	141.0	52.0	135.7	211.0
36-60	60.1	54.1	0.0	5.0	29.1	30.1	25.0
61-90	104.7	107.7	0.0	0.0	28.7	25.7	79.0
91-180	20.8	46.5	0.0	0.0	26.5	0.8	20.0
>180	18.0	12.4	0.0	9.6	7.4	3.4	5.0
Total	1321.0	1257.6	552.6	619.6	212.5	208.9	492.5

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

Sectores	8 al 12 de abril				15 al 19 de abril				22 al 26 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	60	131	6321	6312	53	105	2816	3675	9	152	3613	4158
Intragruppo y off-shore***	0	0	2902	2201	0	0	2369	1432	0	0	2242	1114
Otros	131	60	1606	2316	105	53	213	290	152	9	758	1341
Total	191	191	10829	10829	159	159	5398	5398	161	161	6613	6613

* 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.