

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2019

Fecha de Información: 09 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\$2629.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	787.2	157.4	121.0	740.6	20.4	30.6	16.0
15-35	453.4	995.1	782.3	118.0	92.0	214.6	120.8
36-60	28.1	65.7	0.0	0.0	55.7	18.1	10.0
61-90	26.1	17.6	0.0	0.0	17.2	25.7	0.4
91-180	63.5	85.8	10.0	10.0	27.2	4.9	48.7
>180	130.6	54.3	10.1	90.0	4.3	0.6	40.0
Total	1489.0	1376.0	923.3	958.6	216.8	294.5	235.9

* 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	0.6 %	2.2 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
61-90	1.9 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	1.8 %	1.9 %	1.8 %
Total	1.8 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %

*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**	61	128	6659	6410	54	106	3068	3714	9	155	3857	4208
Intragruppo y off-shore***	0	0	2972	2471	0	0	2404	1737	0	0	2263	1308
Otros	128	61	1619	2369	106	54	216	237	155	9	764	1369
Total	189	189	11250	11250	159	159	5688	5688	164	164	6885	6885

* 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.