

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2019

Fecha de Información: 10 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\$2344.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	622.8	175.1	66.0	436.0	26.1	103.8	83.0
15-35	551.0	952.4	531.0	96.8	184.9	217.8	236.5
36-60	15.3	31.9	0.0	0.0	31.9	15.3	0.0
61-90	47.7	18.3	0.0	41.1	18.0	6.3	0.3
91-180	42.5	85.5	0.0	10.0	53.5	0.5	32.0
>180	50.5	127.7	0.0	20.0	102.7	5.5	25.0
Total	1329.9	1390.9	597.0	603.9	417.1	349.2	376.8

* 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	2.1 %	2.4 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	1.7 %	2.1 %
61-90	1.9 %	2.3 %	1.9 %	2.2 %
91-180	1.9 %	2.1 %	1.1 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %
Total	2.0 %	2.1 %	1.8 %	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**	71	130	7013	6523	53	108	3227	3767	9	160	3964	4215
Intragrupa y off-shore***	0	0	2998	2737	0	0	2444	1886	0	0	2263	1331
Otros	130	71	1622	2374	108	53	229	247	160	9	771	1453
Total	201	201	11633	11633	161	161	5900	5900	169	169	6999	6999

* 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.