

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2019

Fecha de Información: 11 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\$1932.4 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	201.1	243.8	178.7	115.1	20.2	41.0	45.0
15-35	738.8	638.9	413.0	337.5	142.4	317.8	83.5
36-60	17.9	15.9	4.0	4.0	11.9	13.9	0.0
61-90	15.3	15.6	0.0	0.0	15.6	15.3	0.0
91-180	57.2	54.8	25.0	50.0	24.8	2.2	5.0
>180	35.9	35.7	10.0	9.6	20.7	21.3	5.0
Total	1066.2	1004.7	630.7	516.2	235.6	411.5	138.5

* 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	2.1 %	1.1 %	2.1 %	1.6 %
15-35	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
Total	2.1 %	1.8 %	1.9 %	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**	71	138	7036	6563	53	105	3263	3785	9	162	4111	4436
Intragruppo y off-shore***	0	0	3032	2768	0	0	2459	1924	0	0	2429	1400
Otros	138	71	1623	2361	105	53	232	245	162	9	787	1490
Total	209	209	11692	11692	159	159	5954	5954	171	171	7327	7327

* 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.