

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2019

Fecha de Información: 22 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\$918.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	242.5	239.9	58.7	69.0	36.2	28.5	145.0
15-35	207.1	312.9	139.0	58.5	93.9	68.6	80.0
36-60	43.3	4.3	0.0	0.0	2.8	41.8	1.5
61-90	0.6	12.5	0.0	0.0	12.5	0.6	0.0
91-180	2.1	27.1	0.0	0.0	27.1	2.1	0.0
>180	51.8	51.0	0.3	0.0	0.7	1.8	50.0
Total	547.4	647.7	198.0	127.5	173.2	143.4	276.5

* 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	2.3 %	2.1 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.1 %	2.6 %	2.1 %	2.4 %
36-60	1.9 %	3.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	5.1 %	1.7 %	4.9 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.5 %	1.9 %
Total	2.2 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %

*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	22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	166	4684	4902	13	141	3591	3622	16	102	3835	4092
Intragruppo y off-shore***	0	0	2586	1659	0	0	1801	1348	0	0	2220	738
Otros	166	15	852	1560	141	13	620	1042	102	16	682	1907
Total	180	180	8122	8122	155	155	6012	6012	118	118	6737	6737

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.