

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2019

Fecha de Información: 23 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\$3335.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	954.4	608.3	129.0	365.0	292.9	403.0	186.4
15-35	702.5	1078.4	599.6	124.5	217.8	317.0	261.0
36-60	48.8	1.6	0.0	0.0	1.6	48.8	0.0
61-90	2.6	12.8	0.0	0.0	12.8	2.6	0.0
91-180	117.0	44.9	14.0	70.4	10.9	26.6	20.0
>180	194.4	182.5	11.0	30.0	26.5	19.4	145.0
Total	2019.7	1928.5	753.6	589.9	562.5	817.4	612.4

* 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	2.2 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.1 %	3.9 %	2.4 %
91-180	2.0 %	2.5 %	1.9 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %

*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	206	5064	5042	15	103	4097	4044	16	102	4075	4304
Intragrupo y off-shore***	0	0	2658	1973	0	0	1857	1399	0	0	2223	748
Otros	206	15	854	1560	103	15	909	1422	102	16	835	2081
Total	221	221	8575	8575	118	118	6864	6864	118	118	7133	7133

* 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 intragrupo.