

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2019

Fecha de Información: 24 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\$2623.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	537.2	216.3	50.7	316.0	65.3	120.9	100.3
15-35	578.5	1111.4	735.5	102.7	161.6	261.5	214.3
36-60	136.3	85.3	49.0	5.0	6.3	101.3	30.0
61-90	38.0	5.0	0.7	0.0	4.3	38.0	0.0
91-180	75.1	34.3	1.2	6.6	13.1	48.6	20.0
>180	151.4	96.2	0.5	32.0	18.7	42.4	77.0
Total	1516.6	1548.5	837.6	462.3	269.3	612.7	441.6

* 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 %		2.1 %	1.5 %	1.7 %
15-35	2.2 %		2.1 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %		2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-		2.0 %	1.8 %	1.8 %
91-180	1.9 %		1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.9 %		1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	2.1 %		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	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**	16	217	5357	5100	17	102	4231	4167	17	101	4224	4367
Intragrupo y off-shore***	0	0	2682	2234	0	0	1871	1434	0	0	2258	773
Otros	217	16	862	1567	102	17	968	1469	101	17	841	2183
Total	233	233	8901	8901	118	118	7070	7070	119	119	7323	7323

* 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 intragrupo.