

Fecha de Publicación: 30 de abril de 2019

Fecha de Información: 26 de abril de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1602.3 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	170.5	141.9	60.0	82.5	23.5	29.6	58.4
15-35	596.6	623.0	274.4	71.5	289.2	465.7	59.4
36-60	28.5	8.8	0.0	0.0	3.8	23.5	5.0
61-90	31.8	3.3	0.0	10.0	3.3	21.8	0.0
91-180	21.1	8.7	0.0	3.3	8.7	17.8	0.0
>180	78.0	17.9	0.0	7.0	12.9	66.0	5.0
Total	926.5	803.6	334.4	174.3	341.4	624.4	127.8

* 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	
3-14	2.1 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.0 %	2.5 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	1.8 %
91-180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
Total	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	223	5578	5167	18	98	4405	4272	23	99	4453	4500
Intragrupo y off-shore***	0	0	2699	2406	0	0	1947	1528	0	0	2310	907
Otros	223	15	871	1574	98	18	969	1521	99	23	882	2237
Total	239	239	9148	9148	116	116	7321	7321	122	122	7645	7645

* 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.