

Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2019

Fecha de Información: 29 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\$2010.5 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	375.9	288.8	136.5	238.2	29.3	14.7	123.0
15-35	527.6	693.1	384.6	198.0	248.5	269.6	60.0
36-60	66.8	48.6	20.5	6.5	14.1	46.2	14.1
61-90	0.9	12.8	0.0	0.0	12.8	0.9	0.0
91-180	32.5	31.0	0.3	0.0	10.4	12.2	20.3
>180	135.7	104.1	0.0	20.0	14.1	25.7	90.0
Total	1139.4	1178.4	541.9	462.7	329.2	369.3	307.4

* 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 %		2.3 %	1.4 %	1.8 %
15-35	2.1 %		2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %		2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-		2.0 %	1.3 %	1.9 %
91-180	1.9 %		2.0 %	1.7 %	1.9 %
>180	1.9 %		1.9 %	1.7 %	1.9 %
Total	2.1 %		2.2 %	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	29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	103	4673	4492	25	102	4554	4560	31	132	2681	2659
Intragrupo y off-shore***	0	0	2079	1726	0	0	2315	948	0	0	1041	503
Otros	103	18	987	1522	102	25	884	2244	132	31	759	1319
Total	121	121	7739	7739	127	127	7752	7752	164	164	4481	4481

* 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.