

Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2019

Fecha de Información: 30 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\$1817.4 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	319.5	222.0	62.5	173.5	47.0	33.5	112.5
15-35	512.4	543.1	389.3	160.7	44.3	242.2	109.5
36-60	58.2	125.9	84.0	0.0	8.9	25.2	33.0
61-90	0.8	15.6	1.1	0.0	14.6	0.8	0.0
91-180	130.9	48.0	0.0	115.0	38.0	5.9	10.0
>180	60.9	70.2	23.0	10.0	22.2	25.9	25.0
Total	1082.6	1024.8	559.9	459.2	174.9	333.4	290.0

* 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 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.1 %		2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %		3.9 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-		2.1 %	8.2 %	2.4 %
91-180	1.9 %		2.1 %	2.3 %	2.1 %
>180	1.9 %		2.2 %	1.7 %	1.9 %
Total	2.1 %		2.2 %	2.1 %	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	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	100	4856	4608	26	106	4673	4645	32	134	2717	2696
Intragrupo y off-shore***	0	0	2130	1850	0	0	2325	994	0	0	1062	516
Otros	100	18	999	1527	106	26	898	2257	134	32	773	1340
Total	118	118	7986	7986	132	132	7896	7896	166	166	4552	4552

* 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.