

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2019

Fecha de Información: 03 de mayo 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\$2555.0 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	528.2	280.7	99.5	412.5	77.5	12.0	103.7
15-35	403.6	566.7	424.6	165.4	77.9	174.0	64.2
36-60	50.2	164.7	0.0	40.0	164.7	10.2	0.0
61-90	355.0	307.2	160.0	0.0	147.2	355.0	0.0
91-180	3.6	7.8	0.0	0.0	7.8	3.6	0.0
>180	36.6	23.6	10.0	30.0	8.6	1.6	5.0
Total	1377.2	1350.7	694.1	647.9	483.7	556.4	172.9

* 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 %	1.9 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
36-60	-	2.0 %	2.1 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.9 %	1.9 %
91-180	-	2.1 %	2.6 %	2.2 %
>180	1.8 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.0 %	2.0 %	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	4894	4635	30	106	5172	5830	35	134	2837	2804
Intragrupo y off-shore***	0	0	2130	1883	0	0	2709	1356	0	0	1129	589
Otros	103	18	1012	1517	106	30	1581	2275	134	35	777	1350
Total	121	121	8036	8036	136	136	9461	9461	169	169	4743	4743

* 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.