

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2019

Fecha de Información: 06 de mayo 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\$2033.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	352.4	327.2	177.5	211.0	47.7	39.4	102.0
15-35	700.3	608.6	338.5	241.0	155.6	344.8	114.5
36-60	33.4	39.6	0.0	0.0	39.6	33.4	0.0
61-90	14.6	31.6	0.0	0.0	31.6	14.6	0.0
91-180	21.5	25.1	0.0	3.7	25.1	17.9	0.0
>180	74.1	24.2	20.0	66.1	1.2	5.0	3.0
Total	1196.4	1056.2	536.0	521.8	300.7	455.1	219.5

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	1.8 %	2.0 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.0 %	1.2 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
Total	2.0 %	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	6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	109	5427	5988	35	134	2933	2997	21	204	2982	4565
Intragruo y off-shore***	0	0	2821	1567	0	0	1219	589	0	0	2859	849
Otros	109	30	1588	2281	134	35	815	1381	204	21	788	1214
Total	140	140	9836	9836	169	169	4967	4967	225	225	6628	6628

* 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 intragruo.