

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2019

Fecha de Información: 08 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\$2936.6 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	850.6	312.8	131.0	611.5	18.8	76.1	163.0
15-35	842.3	1047.1	610.5	292.0	87.6	201.3	349.0
36-60	129.9	123.0	0.0	0.0	123.0	129.9	0.0
61-90	41.3	43.3	0.0	0.0	43.3	41.3	0.0
91-180	5.0	15.9	10.4	0.0	5.5	5.0	0.0
>180	32.0	15.5	3.0	11.0	2.5	11.0	10.0
Total	1901.1	1557.5	754.9	914.5	280.6	464.6	522.0

* 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	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
36-60	-	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.8 %
>180	1.8 %	2.1 %	2.0 %	1.9 %
Total	2.0 %	2.0 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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**	28	115	6416	6381	36	134	3038	3082	24	206	3359	4804
Intragrupo y off-shore***	0	0	2970	2336	0	0	1245	630	0	0	2989	919
Otros	115	28	1621	2290	134	36	819	1390	206	24	803	1427
Total	143	143	11007	11007	170	170	5102	5102	230	230	7151	7151

* 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.