

Fecha de Publicación: 14 de mayo de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1573.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	476.1	314.1	132.8	250.1	26.3	71.0	155.0
15-35	353.7	607.2	410.6	62.0	106.6	201.7	90.0
36-60	0.5	3.0	0.0	0.0	3.0	0.5	0.0
61-90	5.1	5.2	0.0	0.0	5.2	5.1	0.0
91-180	7.6	13.5	0.0	0.0	13.5	7.6	0.0
>180	31.7	28.1	0.0	0.0	1.1	4.7	27.0
Total	874.7	971.1	543.4	312.1	155.7	290.6	272.0

* 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	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	1.3 %	2.2 %
61-90	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
>180	2.2 %	2.1 %	1.3 %	2.1 %
Total	2.0 %	2.1 %	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	113	6517	6487	38	137	3609	3647	26	208	3691	5044
Intragrupa y off-shore***	0	0	3027	2400	0	0	1521	899	0	0	3042	1027
Otros	113	28	1636	2294	137	38	837	1421	208	26	854	1516
Total	142	142	11180	11180	175	175	5967	5967	234	234	7587	7587

* 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.