Fecha de Publicación: 29 de abril de 2019

Fecha de Información: 25 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$2675.4 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	463.5	125.2	44.4	318.0	30.3	95.0	50.5
15-35	642.6	1205.4	777.1	211.0	173.8	177.1	254.5
36-60	23.4	47.3	41.8	2.4	1.4	17.0	4.0
61-90	28.2	27.1	0.0	0.0	27.1	28.2	0.0
91-180	20.6	8.8	0.0	4.0	8.8	16.6	0.0
>180	300.7	139.6	73.0	171.0	18.6	81.7	48.0
Total	**1479.1**	**1553.4**	**936.3**	**706.4**	**260.0**	**415.7**	**357.0**

* 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	2.3 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
15-35	1.9 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.1 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	2.2 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.8 %	1.8 %
Total	1.9 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %

*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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	222	5579	5166	18	99	4304	4192	18	100	4393	4442
Intragrupo y off-shore***	0	0	2699	2406	0	0	1887	1446	0	0	2310	907
Otros	222	15	870	1575	99	18	967	1520	100	18	863	2217
Total	**238**	**238**	**9148**	**9148**	**117**	**117**	**7158**	**7158**	**118**	**118**	**7566**	**7566**

* 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.