

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2019

Fecha de Información: 09 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\$2352.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	481.2	556.3	253.9	167.0	47.4	59.2	255.0
15-35	702.1	865.3	482.8	123.5	141.5	337.6	241.0
36-60	6.5	9.0	0.0	0.4	9.0	6.1	0.0
61-90	69.4	29.9	0.0	4.3	29.9	65.1	0.0
91-180	12.0	59.8	32.0	0.0	27.8	12.0	0.0
>180	38.7	28.5	0.0	20.0	18.5	8.7	10.0
Total	1309.9	1549.0	768.7	315.2	274.3	488.6	506.0

* 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	4.6 %	1.9 %	1.6 %	2.9 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.4 %	1.4 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.9 %
>180	1.8 %	2.0 %	1.7 %	1.8 %
Total	3.3 %	2.0 %	1.8 %	2.3 %

* 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	6517	6486	37	135	3331	3425	25	207	3495	4954
Intragruppo y off-shore***	0	0	3027	2400	0	0	1410	733	0	0	3020	942
Otros	115	28	1634	2294	135	37	837	1419	207	25	831	1450
Total	143	143	11179	11179	172	172	5578	5578	232	232	7346	7346

* 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.