

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2019

Fecha de Información: 24 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\$1297.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	262.5	63.4	30.0	221.2	18.4	26.3	15.0
15-35	410.9	427.8	302.7	112.8	18.2	191.3	106.9
36-60	8.8	16.0	0.0	0.0	16.0	8.8	0.0
61-90	15.6	60.5	30.0	0.0	15.5	0.6	15.0
91-180	39.6	41.9	10.0	20.0	16.9	4.6	15.0
>180	89.0	41.0	0.0	50.0	13.0	11.0	28.0
Total	826.4	650.7	372.7	404.0	98.1	242.6	179.9

* 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	2.6 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.3 %	1.9 %	2.2 %
61-90	2.1 %	2.1 %	1.8 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.3 %	1.9 %	2.0 %
Total	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %

*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	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	150	5871	5880	22	179	3471	3623	28	86	3371	4054
Intragrupo y off-shore***	0	0	3363	2727	0	0	1796	1244	0	0	2233	1023
Otros	150	39	1007	1633	179	22	1021	1421	86	28	702	1229
Total	189	189	10240	10240	201	201	6288	6288	114	114	6306	6306

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