

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2019

Fecha de Información: 27 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\$142.0 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	73.3	71.3	0.0	3.5	4.3	2.8	67.0
15-35	41.3	36.6	6.0	6.0	3.6	8.3	27.0
36-60	0.5	0.7	0.0	0.0	0.7	0.5	0.0
61-90	0.0	1.0	0.0	0.0	1.0	0.0	0.0
91-180	5.1	1.7	0.0	0.0	1.7	5.1	0.0
>180	1.0	3.3	0.0	0.2	3.3	0.8	0.0
Total	121.3	114.7	6.0	9.7	14.7	17.6	94.0

* 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 %	2.0 %	1.7 %	2.2 %
15-35	2.2 %	2.9 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.9 %	0.9 %	2.1 %
61-90	-	3.3 %	0.9 %	3.3 %
91-180	-	2.9 %	1.9 %	2.1 %
>180	-	2.1 %	1.7 %	2.0 %
Total	2.3 %	2.5 %	1.9 %	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	27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio				10 al 14 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	184	3592	3788	31	86	3395	4076	52	88	4055	4371
Intragrupo y off-shore***	0	0	1845	1244	0	0	2233	1027	0	0	2331	1002
Otros	184	24	1019	1426	86	31	707	1231	88	52	733	1746
Total	209	209	6457	6457	116	116	6335	6335	140	140	7119	7119

* 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.