

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2019

Fecha de Información: 28 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\$1699.8 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	193.7	169.5	34.5	36.0	17.0	39.7	118.0
15-35	769.1	523.3	217.1	187.9	84.4	359.4	221.8
36-60	87.6	69.1	0.0	0.0	61.1	79.6	8.0
61-90	30.9	42.9	0.0	2.0	42.9	28.9	0.0
91-180	64.0	67.2	20.0	30.0	27.2	14.0	20.0
>180	8.3	41.8	40.0	0.0	1.8	8.3	0.0
Total	1153.6	914.0	311.6	255.9	234.5	529.9	367.8

* 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	2.2 %	2.6 %	2.0 %	2.3 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
36-60	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
61-90	-	2.0 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
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	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**	25	185	3719	3887	36	84	3410	4099	53	88	4171	4420
Intragrupo y off-shore***	0	0	1868	1271	0	0	2245	1036	0	0	2332	1032
Otros	185	25	1023	1452	84	36	717	1238	88	53	736	1787
Total	210	210	6609	6609	120	120	6372	6372	141	141	7239	7239

* 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.