

Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2019

Fecha de Información: 29 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\$2816.4 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	585.2	197.0	84.9	419.0	50.6	104.8	61.5
15-35	614.8	1114.9	646.2	162.0	196.7	180.8	272.0
36-60	139.6	125.4	0.0	0.0	120.4	134.6	5.0
61-90	39.7	36.4	0.0	0.0	21.4	24.7	15.0
91-180	161.7	54.4	0.0	0.0	19.4	126.7	35.0
>180	125.9	60.0	6.4	62.4	3.4	13.3	50.3
Total	1666.9	1588.2	737.5	643.4	412.0	584.8	438.7

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

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	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**	29	186	4108	3966	37	84	3498	4146	60	90	4327	4638
Intragrupa y off-shore***	0	0	1890	1610	0	0	2257	1106	0	0	2456	1042
Otros	186	29	1029	1451	84	37	752	1256	90	60	753	1855
Total	215	215	7027	7027	121	121	6507	6507	149	149	7536	7536

* 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.