

Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2019

Fecha de Información: 16 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\$2257.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	503.3	141.3	29.0	384.0	36.5	43.6	75.8
15-35	621.8	643.7	288.8	177.7	113.4	202.6	241.5
36-60	9.3	233.9	200.0	0.0	33.9	9.3	0.0
61-90	102.0	182.7	70.0	0.0	12.7	2.0	100.0
91-180	27.4	53.3	10.0	0.0	23.3	7.4	20.0
>180	99.9	76.9	75.0	79.3	0.9	19.6	1.0
Total	1363.7	1331.8	672.8	641.0	220.7	284.4	438.3

* 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 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.1 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.0 %	1.8 %	2.0 %
61-90	2.0 %	2.6 %	1.0 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.7 %	1.7 %
Total	2.1 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %

* 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

Sector	13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	146	4360	4041	45	212	4479	5442	8	160	2980	3154
Intragrupa y off-shore***	0	0	1691	1430	0	0	3214	1578	0	0	1522	986
Otros	146	29	829	1410	212	45	928	1602	160	8	934	1296
Total	175	175	6880	6880	256	256	8622	8622	168	168	5436	5436

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