

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2019

Fecha de Información: 14 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\$3312.4 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	619.6	310.7	89.0	408.0	21.3	11.2	200.4
15-35	1265.1	1465.0	658.6	254.0	203.2	407.9	603.2
36-60	60.0	136.6	62.4	0.0	71.8	57.6	2.4
61-90	4.2	6.0	0.0	0.0	6.0	4.2	0.0
91-180	7.1	108.7	90.0	0.0	17.7	6.1	1.0
>180	109.6	41.7	20.0	50.0	6.7	44.6	15.0
Total	2065.6	2068.8	920.0	712.0	326.8	531.6	822.0

* 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	2.1 %	2.4 %	1.5 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	1.9 %	1.9 %	2.1 %	2.0 %
61-90	-	2.1 %	4.3 %	3.0 %
91-180	1.9 %	2.2 %	3.2 %	2.4 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
Total	2.1 %	2.1 %	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**	31	142	4249	3923	38	209	3879	5251	8	158	2883	3080
Intragrupa y off-shore***	0	0	1624	1362	0	0	3144	1101	0	0	1496	965
Otros	142	31	834	1423	209	38	877	1548	158	8	923	1258
Total	173	173	6708	6708	247	247	7900	7900	166	166	5303	5303

* 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.