

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2019

Fecha de Información: 20 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\$2432.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	491.4	258.6	159.7	408.4	60.9	45.0	38.0
15-35	642.9	990.9	658.2	149.0	166.5	327.7	166.3
36-60	34.0	28.3	0.0	4.1	24.3	25.9	4.0
61-90	5.2	3.2	0.0	0.0	3.2	5.2	0.0
91-180	36.5	77.2	30.0	14.0	46.8	22.1	0.4
>180	34.4	38.0	30.0	20.1	7.9	14.2	0.1
Total	1244.5	1396.2	877.9	595.6	309.6	440.1	208.8

* 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 %	2.3 %	1.6 %	1.8 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.0 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.2 %	2.4 %	2.3 %
91-180	1.9 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
>180	1.6 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
Total	2.2 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %

*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	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	142	5080	5735	13	176	3055	3369	15	84	3254	3926
Intragrupa y off-shore***	0	0	3376	2091	0	0	1697	1003	0	0	2194	1016
Otros	142	45	980	1611	176	13	964	1345	84	15	672	1178
Total	188	188	9437	9437	189	189	5717	5717	99	99	6120	6120

* 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.