

Fecha de Publicación: 5 de junio de 2019

Fecha de Información: 31 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\$2567.7 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	685.6	299.1	80.0	440.5	27.1	53.1	192.0
15-35	663.9	832.4	594.5	240.3	23.9	209.6	214.0
36-60	64.4	69.1	0.0	0.0	64.1	59.4	5.0
61-90	37.8	38.4	10.0	0.0	28.3	37.8	0.0
91-180	39.7	47.9	12.2	0.0	25.7	29.7	10.0
>180	149.7	170.7	60.0	27.0	0.7	12.7	110.0
Total	1641.2	1457.5	756.7	707.8	169.8	402.4	531.0

* 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	2.3 %	2.4 %	1.7 %	1.9 %
15-35	2.4 %	2.3 %	2.1 %	2.3 %
36-60	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.1 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.4 %	1.8 %	2.0 %
Total	2.3 %	2.3 %	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	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**	30	185	4287	3989	42	83	4284	4497	62	93	4443	4741
Intragrupa y off-shore***	0	0	1905	1775	0	0	2406	1672	0	0	2484	1088
Otros	185	30	1036	1465	83	42	781	1302	93	62	779	1877
Total	215	215	7228	7228	125	125	7471	7471	155	155	7706	7706

* 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.