

Fecha de Publicación: 15 de mayo de 2019

Fecha de Información: 13 de mayo de 2019 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

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**	35	141	3764	3790	31	207	3769	5108	8	158	2831	2997
Intragruppo y off-shore***	0	0	1605	999	0	0	3074	1057	0	0	1463	964
Otros	141	35	839	1420	207	31	866	1544	158	8	919	1252
Total	176	176	6208	6208	237	237	7709	7709	165	165	5213	5213

* 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.

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2118.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	238.8	206.0	116.0	130.0	13.5	32.3	76.5
15-35	776.8	661.7	323.0	321.2	123.2	240.1	215.5
36-60	47.5	69.4	0.0	2.0	49.4	25.5	20.0
61-90	12.3	0.8	0.0	6.0	0.8	6.3	0.0
91-180	16.2	236.3	190.0	0.0	46.3	16.2	0.0
>180	143.5	95.5	20.0	30.0	1.5	39.5	74.0
Total	1235.1	1269.7	649.0	489.2	234.7	359.9	386.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
15-35	2.1 %	1.9 %	2.0 %	2.0 %
36-60	1.9 %	2.0 %	1.6 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.8 %	2.1 %
>180	2.0 %	1.8 %	1.9 %	1.9 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %

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