

Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2019

Fecha de Información: 17 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\$1836.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	198.9	258.9	177.4	122.0	31.2	26.7	50.3
15-35	590.9	595.2	210.0	200.3	123.2	128.6	262.0
36-60	5.3	115.7	0.0	0.0	115.7	5.3	0.0
61-90	66.8	125.2	70.0	10.0	5.2	6.8	50.0
91-180	12.0	28.3	0.0	0.2	28.0	11.5	0.4
>180	125.0	142.2	70.0	50.0	7.2	10.0	65.0
Total	998.9	1265.5	527.4	382.5	310.5	188.9	427.6

* 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	2.1 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
15-35	2.1 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	2.1 %
61-90	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
Total	2.0 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %

*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

Sectores	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	144	4360	4041	49	157	4635	5588	9	163	3014	3262
Intragruppo y off-shore***	0	0	1691	1430	0	0	3306	1694	0	0	1608	992
Otros	144	29	829	1410	157	49	942	1602	163	9	947	1315
Total	173	173	6881	6881	206	206	8883	8883	173	173	5569	5569

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