

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2019

Fecha de Información: 22 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\$2488.9 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	676.3	206.6	78.0	543.0	31.6	36.3	97.0
15-35	506.9	914.4	644.8	178.8	98.2	156.6	171.5
36-60	118.2	133.7	0.0	0.0	123.7	108.2	10.0
61-90	54.0	137.8	100.0	6.3	7.5	17.4	30.3
91-180	1.5	10.8	1.6	0.0	9.2	1.5	0.0
>180	16.8	20.9	20.0	14.0	0.6	2.5	0.2
Total	1373.7	1424.2	844.3	742.1	270.9	322.6	309.1

* 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 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
36-60	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.0 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %
91-180	-	2.1 %	1.3 %	2.0 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.8 %	1.8 %
Total	2.2 %	2.1 %	2.1 %	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**	42	150	5890	5951	16	173	3159	3567	23	83	3342	4023
Intragrupa y off-shore***	0	0	3449	2759	0	0	1799	1003	0	0	2219	1016
Otros	150	42	1017	1646	173	16	983	1371	83	23	686	1208
Total	192	192	10355	10355	189	189	5941	5941	107	107	6247	6247

* 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 intragrupo.