

Fecha de Publicación: 4 de junio de 2019

Fecha de Información: 30 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\$2743.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	408.2	162.2	108.0	337.0	24.2	41.2	30.0
15-35	782.7	1247.0	739.0	204.0	120.0	190.7	388.0
36-60	84.2	117.7	111.6	81.0	6.1	3.2	0.0
61-90	104.6	20.5	0.0	0.0	15.5	99.6	5.0
91-180	66.7	37.0	0.0	40.0	22.0	11.7	15.0
>180	144.7	114.3	0.0	25.0	6.3	11.7	108.0
Total	1591.0	1698.6	958.6	687.0	194.0	358.0	546.0

* 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 %	2.2 %	2.2 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.3 %
36-60	-	2.5 %	1.8 %	2.3 %
61-90	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.1 %	2.1 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %

*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	186	4288	3989	39	84	3673	4253	60	90	4377	4681
Intragruppo y off-shore***	0	0	1905	1775	0	0	2332	1243	0	0	2478	1077
Otros	186	30	1036	1466	84	39	754	1264	90	60	774	1871
Total	216	216	7229	7229	123	123	6759	6759	150	150	7629	7629

* 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.