

Fecha de Publicación: 11 de junio de 2019

Fecha de Información: 07 de junio 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\$1570.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	157.7	299.4	182.0	53.5	76.4	63.2	41.0
15-35	306.1	561.9	395.6	143.0	38.4	35.1	128.0
36-60	41.6	52.9	0.0	10.0	52.9	31.6	0.0
61-90	121.3	42.6	0.0	105.0	32.6	6.3	10.0
91-180	21.7	37.0	0.0	20.0	37.0	1.7	0.0
>180	102.1	55.3	0.0	25.0	5.3	27.1	50.0
Total	750.6	1049.2	577.6	356.5	242.6	165.1	229.0

* 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	2.6 %	2.4 %	1.7 %	2.2 %
15-35	2.5 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
36-60	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
61-90	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
91-180	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.1 %	2.5 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.4 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %

*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	3 al 7 de junio				10 al 14 de junio				17 al 21 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	77	3405	4110	53	95	4227	4504	14	173	3947	5178
Intragrupa y off-shore***	0	0	2245	1036	0	0	2403	1077	0	0	2957	1142
Otros	77	32	729	1233	95	53	749	1798	173	14	887	1472
Total	109	109	6379	6379	147	147	7379	7379	187	187	7792	7792

* 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.