

Fecha de Publicación: 17 de junio de 2019

Fecha de Información: 13 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\$2900.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	861.5	586.5	160.7	417.0	23.3	42.0	402.5
15-35	669.0	838.4	456.6	243.0	39.3	83.5	342.5
36-60	81.6	155.6	117.0	0.0	30.6	73.6	8.0
61-90	7.1	11.2	0.0	0.0	11.2	7.1	0.0
91-180	175.8	255.6	113.0	50.0	29.6	12.8	113.0
>180	119.9	57.5	0.4	65.1	4.1	1.8	53.0
Total	1914.9	1904.7	847.7	775.1	138.0	220.8	919.0

* 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 %	2.5 %	2.0 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.6 %	2.6 %
36-60	2.6 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
91-180	2.3 %	2.2 %	2.3 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.6 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %

*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	10 al 14 de junio				17 al 21 de junio				24 al 28 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	69	113	5498	5722	27	183	5208	5812	25	176	3202	4415
Intragrupa y off-shore***	0	0	2782	1861	0	0	2914	1533	0	0	2122	768
Otros	113	69	1178	1875	183	27	934	1711	176	25	941	1082
Total	182	182	9457	9457	210	210	9056	9056	201	201	6265	6265

* 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.