

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2019

Fecha de Información: 17 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\$2440.6 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	487.7	195.1	104.0	393.1	12.1	15.7	79.0
15-35	305.7	965.9	464.5	60.9	409.4	152.7	92.0
36-60	105.4	78.6	10.0	0.0	68.6	105.4	0.0
61-90	5.9	0.6	0.0	0.0	0.6	5.9	0.0
91-180	413.1	37.7	25.1	0.0	12.5	413.1	0.0
>180	3.1	12.8	0.0	0.0	12.8	3.1	0.0
Total	1320.8	1290.8	603.6	454.0	516.2	695.8	171.0

* 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 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	3.1 %	2.3 %	2.4 %
91-180	-	2.4 %	2.2 %	2.2 %
>180	-	2.4 %	1.8 %	2.3 %
Total	2.6 %	2.6 %	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	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	185	5971	6195	29	176	3251	4549	11	64	2637	3641
Intragrupa y off-shore***	0	0	3160	2165	0	0	2227	790	0	0	2258	652
Otros	185	27	942	1712	176	29	950	1088	64	11	363	964
Total	212	212	10072	10072	205	205	6427	6427	75	75	5257	5257

* 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.