

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2019

Fecha de Información: 20 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\$2280.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	220.4	150.2	60.5	162.0	51.7	20.4	38.0
15-35	748.6	767.4	520.5	371.0	114.2	244.9	132.7
36-60	85.7	43.3	0.0	0.0	43.3	85.7	0.0
61-90	15.5	47.8	0.0	10.0	47.8	5.5	0.0
91-180	13.9	120.1	0.0	7.9	120.1	6.1	0.0
>180	155.9	147.9	18.1	85.0	64.8	5.9	65.0
Total	1239.9	1276.7	599.1	635.9	441.9	368.4	235.7

* 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 %	2.7 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-	3.1 %	2.3 %	2.5 %
61-90	-	2.6 %	1.8 %	2.5 %
91-180	-	2.4 %	0.4 %	2.3 %
>180	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %

*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**	26	177	6725	6503	32	197	3519	4698	12	69	2783	3786
Intragrupa y off-shore***	0	0	3265	2720	0	0	2296	996	0	0	2296	677
Otros	177	26	963	1729	197	32	991	1112	69	12	431	1047
Total	203	203	10953	10953	228	228	6806	6806	81	81	5510	5510

* 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.