

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2019

Fecha de Información: 21 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\$1375.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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 | 293.1 | 195.5 | 114.7 | 219.8 | 21.9 | 14.4 | 58.9 |
| 15-35 | 200.6 | 394.4 | 333.1 | 121.8 | 38.3 | 55.8 | 23.0 |
| 36-60 | 107.4 | 73.3 | 0.0 | 0.0 | 73.3 | 107.4 | 0.0 |
| 61-90 | 13.8 | 19.7 | 0.0 | 9.3 | 19.7 | 4.5 | 0.0 |
| 91-180 | 13.2 | 44.5 | 0.0 | 0.0 | 34.5 | 3.2 | 10.0 |
| >180 | 52.8 | 78.9 | 45.2 | 25.5 | 13.7 | 7.3 | 20.0 |
| Total | 680.7 | 806.3 | 493.0 | 376.4 | 201.4 | 192.5 | 111.9 |

* 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 | 2.2 % | 2.4 % | 1.9 % | 2.1 % |
| 15-35 | 2.3 % | 2.4 % | 2.2 % | 2.3 % |
| 36-60 | - | 2.4 % | 2.2 % | 2.2 % |
| 61-90 | - | 2.7 % | 2.1 % | 2.6 % |
| 91-180 | 2.2 % | 2.4 % | 1.7 % | 2.3 % |
| >180 | 2.1 % | 2.1 % | 2.1 % | 2.1 % |
| Total | 2.2 % | 2.4 % | 2.1 % | 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 | 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 | 176 | 6725 | 6505 | 31 | 202 | 3745 | 4763 | 13 | 69 | 2847 | 3906 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 3265 | 2720 | 0 | 0 | 2347 | 1202 | 0 | 0 | 2360 | 691 |
| Otros | 176 | 26 | 964 | 1729 | 202 | 31 | 996 | 1123 | 69 | 13 | 438 | 1048 |
| Total | 202 | 202 | 10954 | 10954 | 233 | 233 | 7088 | 7088 | 82 | 82 | 5645 | 5645 |

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.