

Fecha de Publicación: 7 de junio de 2019

Fecha de Información: 05 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\$2778.0 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	599.2	375.1	128.5	340.3	36.6	48.9	210.0
15-35	760.7	894.9	470.5	160.0	51.5	227.9	372.8
36-60	238.6	218.6	0.0	0.0	218.6	238.6	0.0
61-90	46.8	104.4	0.0	0.0	66.4	8.8	38.0
91-180	40.0	29.2	0.0	10.0	29.2	30.0	0.0
>180	57.2	59.2	10.0	23.0	24.2	9.2	25.0
Total	1742.5	1681.4	609.0	533.3	426.5	563.4	645.8

* 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	2.5 %	1.7 %	2.1 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
>180	2.0 %	2.4 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.4 %	2.3 %	2.2 %	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**	42	79	4940	4668	68	99	4786	5012	22	180	4644	5998
Intragrupa y off-shore***	0	0	2481	2234	0	0	2555	1246	0	0	3411	1294
Otros	79	42	792	1311	99	68	816	1898	180	22	878	1641
Total	121	121	8213	8213	166	166	8156	8156	202	202	8934	8934

* 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.