

Fecha de Publicación: 12 de junio de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1571.0 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	126.4	192.6	156.5	104.2	26.1	12.2	10.0
15-35	337.2	327.5	167.5	194.8	35.0	17.5	125.0
36-60	112.9	118.8	0.0	0.0	118.8	112.9	0.0
61-90	14.8	22.8	0.0	0.0	22.8	14.8	0.0
91-180	141.7	185.6	13.5	0.0	172.1	141.7	0.0
>180	57.0	113.5	50.0	10.0	18.5	2.0	45.0
Total	790.2	960.9	387.5	309.0	393.4	301.2	180.0

* 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	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.4 %
91-180	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.3 %	2.4 %	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	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**	70	108	4854	5512	23	184	4468	5192	22	175	2753	3828
Intragrupa y off-shore***	0	0	2657	1312	0	0	2676	1145	0	0	1851	628
Otros	108	70	1173	1860	184	23	864	1671	175	22	907	1055
Total	178	178	8684	8684	206	206	8008	8008	197	197	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.