

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2019

Fecha de Información: 11 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\$2174.7 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	298.4	207.3	110.8	197.5	12.1	16.5	84.4
15-35	502.7	1042.8	697.0	56.6	40.9	141.1	305.0
36-60	89.4	49.2	0.0	0.0	49.2	89.4	0.0
61-90	28.6	31.5	0.0	0.0	31.5	28.6	0.0
91-180	126.8	129.1	0.0	43.6	51.1	5.2	78.0
>180	104.6	62.1	10.0	70.0	21.7	4.3	30.4
Total	1150.4	1522.0	817.7	367.7	206.5	285.0	497.8

* 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	3.1 %	2.2 %	1.9 %	2.2 %
15-35	2.5 %	2.4 %	1.9 %	2.3 %
36-60	-	3.2 %	2.3 %	2.6 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.2 %	2.3 %	1.5 %	2.2 %
>180	2.1 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.5 %	2.4 %	2.0 %	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**	69	112	5081	5590	25	184	4522	5296	22	178	2854	4019
Intragrupa y off-shore***	0	0	2663	1464	0	0	2776	1190	0	0	1963	650
Otros	112	69	1171	1861	184	25	868	1680	178	22	915	1063
Total	181	181	8915	8915	209	209	8166	8166	200	200	5732	5732

* 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.