

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2019

Fecha de Información: 12 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\$2474.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	556.6	299.1	146.3	440.1	61.8	25.5	91.0
15-35	681.9	844.1	490.5	287.2	32.5	73.6	321.1
36-60	114.1	55.2	0.0	0.0	55.2	114.1	0.0
61-90	46.0	13.3	0.0	0.7	3.3	35.3	10.0
91-180	96.2	201.4	110.0	16.0	15.7	4.5	75.7
>180	50.1	23.8	10.0	20.0	3.8	20.1	10.0
Total	1544.9	1436.9	756.8	763.9	172.4	273.2	507.8

* 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	2.8 %	2.4 %	4.0 %	3.4 %
15-35	2.7 %	2.9 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	2.3 %	2.3 %	2.3 %
61-90	2.5 %	3.5 %	2.2 %	2.4 %
91-180	2.3 %	2.1 %	2.2 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
Total	2.6 %	2.6 %	3.1 %	2.8 %

*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	5451	5708	26	186	4634	5411	23	176	2930	4161
Intragrupa y off-shore***	0	0	2769	1819	0	0	2809	1266	0	0	2029	660
Otros	112	69	1177	1870	186	26	926	1691	176	23	932	1070
Total	181	181	9396	9396	213	213	8368	8368	199	199	5891	5891

* 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.