

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2019

Fecha de Información: 14 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\$1331.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	340.0	325.8	247.0	260.7	8.3	8.9	70.5
15-35	268.5	284.3	179.3	119.8	21.0	64.7	84.0
36-60	7.1	4.9	0.0	0.0	4.9	7.1	0.0
61-90	12.2	30.8	0.0	0.0	28.3	9.7	2.5
91-180	103.2	100.3	38.5	82.5	41.3	0.2	20.5
>180	22.8	8.7	0.0	20.0	8.7	2.8	0.0
Total	753.8	754.8	464.8	482.9	112.5	93.4	177.5

* 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 %	2.6 %	1.9 %	2.3 %
15-35	2.7 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
36-60	-	3.0 %	2.3 %	2.6 %
61-90	2.4 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
91-180	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.1 %
Total	2.7 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %

*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	113	5498	5722	30	182	5529	6037	25	176	3218	4515
Intragrupa y off-shore***	0	0	2782	1861	0	0	3076	1792	0	0	2207	770
Otros	113	69	1178	1875	182	30	937	1712	176	25	946	1086
Total	181	181	9458	9458	212	212	9542	9542	201	201	6371	6371

* 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.