

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2019

Fecha de Información: 18 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\$1943.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	334.0	200.6	69.5	179.0	13.1	37.0	118.0
15-35	703.3	638.0	307.3	266.9	82.7	188.5	248.0
36-60	119.3	93.2	0.0	1.0	93.2	118.3	0.0
61-90	1.5	15.3	0.0	0.0	14.3	0.5	1.0
91-180	0.7	105.5	60.0	0.0	45.5	0.7	0.0
>180	49.4	78.4	20.0	20.0	29.4	0.4	29.0
Total	1208.3	1131.1	456.8	466.9	278.3	345.4	396.0

* 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	2.9 %	2.4 %	2.1 %	2.5 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.4 %	2.5 %	2.0 %	2.5 %
91-180	-	2.3 %	1.9 %	2.3 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
Total	2.7 %	2.5 %	2.4 %	2.5 %

*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

Sectores	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	173	6214	6367	31	184	3320	4573	11	66	2659	3652
Intragrupa y off-shore***	0	0	3215	2278	0	0	2241	846	0	0	2264	662
Otros	173	25	944	1728	184	31	960	1102	66	11	364	973
Total	199	199	10373	10373	215	215	6521	6521	77	77	5286	5286

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.