

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2019

Fecha de Información: 25 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\$2156.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	567.9	306.6	147.0	423.5	36.6	21.4	123.0
15-35	430.0	723.0	479.5	197.0	62.4	51.9	181.1
36-60	79.9	39.7	20.0	0.0	19.7	79.9	0.0
61-90	9.6	41.9	5.6	0.0	36.3	9.6	0.0
91-180	6.6	149.9	72.9	0.0	72.1	1.6	5.0
>180	55.3	65.1	18.0	23.0	37.1	22.3	10.0
Total	1149.3	1326.2	742.9	643.5	264.2	186.7	319.1

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	2.1 %	1.4 %	1.8 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
61-90	-	2.9 %	2.1 %	2.8 %
91-180	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.3 %
>180	2.1 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.4 %	2.3 %	1.8 %	2.1 %

*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	24 al 28 de junio				1 al 5 de julio				8 al 12 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	206	4241	4964	21	72	2896	4007	18	108	5460	5865
Intragruppo y off-shore***	0	0	2411	1578	0	0	2443	724	0	0	2644	1609
Otros	206	30	1021	1131	72	21	445	1053	108	18	1589	2219
Total	236	236	7672	7672	93	93	5784	5784	126	126	9693	9693

* 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 intragruppo.