

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2019

Fecha de Información: 26 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\$2166.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	315.2	193.3	84.0	203.5	35.3	37.7	74.0
15-35	594.0	953.0	665.0	220.2	62.1	147.9	225.9
36-60	67.4	83.2	0.0	0.0	83.2	67.4	0.0
61-90	12.8	26.7	0.0	0.0	21.7	7.8	5.0
91-180	24.3	33.4	0.4	10.0	33.0	14.3	0.0
>180	20.5	147.7	45.0	20.0	102.7	0.5	0.0
Total	1034.3	1437.2	794.4	453.7	337.9	275.7	304.9

* 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	2.7 %	2.7 %	2.4 %	2.6 %
15-35	2.4 %	2.1 %	1.9 %	2.1 %
36-60	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
91-180	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
>180	-	2.4 %	1.4 %	2.4 %
Total	2.5 %	2.3 %	2.1 %	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	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	196	4517	5047	29	73	2922	4029	25	123	5494	5913
Intragruppo y off-shore***	0	0	2480	1767	0	0	2443	731	0	0	2681	1626
Otros	196	30	970	1153	73	29	467	1072	123	25	1590	2227
Total	226	226	7967	7967	101	101	5832	5832	148	148	9766	9766

* 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.