

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2019

Fecha de Información: 04 de junio de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2687.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	513.6	233.1	107.0	394.5	30.5	23.5	95.6
15-35	789.0	968.9	627.0	338.1	96.9	205.9	245.0
36-60	157.3	105.2	2.0	70.0	93.2	77.3	10.0
61-90	22.2	69.2	0.0	0.0	57.2	10.2	12.0
91-180	63.0	99.8	20.0	40.0	79.8	23.0	0.0
>180	25.0	9.0	0.0	16.0	4.0	4.0	5.0
Total	1570.3	1485.2	756.0	858.6	361.6	344.1	367.6

* 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	2.4 %		2.9 %	1.8 %	2.1 %
15-35	2.4 %		2.3 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.2 %		2.4 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %		2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-		2.2 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.1 %		2.4 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.4 %		2.4 %	2.1 %	2.2 %

*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	3 al 7 de junio				10 al 14 de junio				17 al 21 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	79	4631	4589	66	97	4600	4807	22	170	4500	5895
Intragrupo y off-shore***	0	0	2453	1972	0	0	2502	1199	0	0	3363	1263
Otros	79	41	786	1309	97	66	793	1889	170	22	878	1583
Total	120	120	7870	7870	163	163	7895	7895	191	191	8741	8741

* 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.