

Fecha de Publicación: 10 de junio de 2019

Fecha de Información: 06 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\$3145.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	255.9	555.1	125.0	156.6	345.1	14.3	85.0
15-35	922.1	973.8	327.0	171.5	139.9	243.6	507.0
36-60	77.0	44.7	1.5	0.0	23.2	57.0	20.0
61-90	584.2	239.8	20.0	35.0	9.8	339.2	210.0
91-180	62.3	118.9	48.3	25.0	40.6	7.3	30.0
>180	62.5	101.2	74.0	20.0	27.3	42.5	0.0
Total	1964.1	2033.5	595.7	408.1	585.8	704.0	852.0

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

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**	42	79	4972	4680	68	100	4874	5468	22	185	4779	6083
Intragrupo y off-shore***	0	0	2486	2267	0	0	2648	1290	0	0	3439	1374
Otros	79	42	799	1310	100	68	1149	1913	185	22	880	1640
Total	121	121	8257	8257	168	168	8671	8671	207	207	9098	9098

* 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.