

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2019

Fecha de Información: 19 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\$2150.2 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	561.5	168.5	47.0	445.3	18.5	13.2	103.0
15-35	603.7	928.1	483.8	116.0	116.3	159.7	328.0
36-60	150.1	52.8	32.0	0.0	10.8	140.1	10.0
61-90	1.4	14.2	0.0	0.0	14.2	1.4	0.0
91-180	16.9	55.9	3.5	0.0	42.4	6.9	10.0
>180	10.3	37.7	16.1	0.0	21.6	10.3	0.0
Total	1343.9	1257.3	582.4	561.3	223.9	331.7	451.0

* 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	2.7 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
36-60	2.4 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	2.6 %	0.8 %	2.5 %
91-180	2.2 %	2.4 %	1.9 %	2.3 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.1 %
Total	2.6 %	2.5 %	2.5 %	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

Sector	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**	26	176	6650	6462	31	187	3407	4614	11	68	2692	3680
Intragrupa y off-shore***	0	0	3252	2656	0	0	2249	908	0	0	2266	667
Otros	176	26	944	1729	187	31	973	1107	68	11	365	976
Total	202	202	10847	10847	218	218	6629	6629	78	78	5323	5323

* 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 intragrupo.