

Fecha de Publicación: 2 de julio de 2019

Fecha de Información: 27 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\$2872.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	631.5	139.4	66.5	571.5	34.9	22.0	38.0
15-35	585.7	1314.5	929.7	197.1	189.8	193.6	195.0
36-60	84.6	153.5	86.0	0.0	67.5	84.6	0.0
61-90	3.4	4.9	0.0	2.6	4.9	0.8	0.0
91-180	7.5	80.4	11.2	0.0	69.2	7.5	0.0
>180	41.1	59.1	0.4	34.9	58.7	6.2	0.0
Total	1353.8	1751.7	1093.7	806.1	425.0	314.7	233.0

* 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	2.5 %	2.7 %	2.3 %	2.4 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	2.5 %	2.0 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.0 %	2.4 %
>180	-	2.3 %	2.2 %	2.3 %
Total	2.4 %	2.4 %	2.2 %	2.4 %

*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**	32	199	4806	5329	28	72	3296	4087	25	122	5599	5901
Intragrupa y off-shore***	0	0	2635	1947	0	0	2475	1073	0	0	2643	1710
Otros	199	32	1090	1255	72	28	483	1094	122	25	1596	2228
Total	231	231	8531	8531	100	100	6255	6255	147	147	9839	9839

* 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.