

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2019

Fecha de Información: 28 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\$1845.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	565.1	421.8	162.0	313.3	21.8	13.8	238.0
15-35	357.3	877.7	506.5	36.0	116.2	66.3	255.0
36-60	26.4	5.5	0.0	0.0	5.5	26.4	0.0
61-90	7.3	15.1	0.0	0.0	15.1	7.3	0.0
91-180	24.4	24.6	0.0	0.0	24.6	24.4	0.0
>180	6.8	6.7	0.0	0.0	6.7	6.8	0.0
Total	987.3	1351.5	668.5	349.3	190.0	145.1	493.0

* 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	2.4 %	2.7 %	1.8 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.6 %	1.8 %	2.5 %
36-60	-	2.8 %	2.2 %	2.3 %
61-90	-	2.5 %	1.4 %	2.1 %
91-180	-	2.6 %	2.0 %	2.3 %
>180	-	2.5 %	2.0 %	2.2 %
Total	2.5 %	2.6 %	1.8 %	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**	31	198	4806	5330	30	73	3853	4374	28	122	5601	6037
Intragruppo y off-shore***	0	0	2635	1947	0	0	2503	1386	0	0	2777	1710
Otros	198	31	1090	1255	73	30	504	1099	122	28	1598	2229
Total	229	229	8531	8531	103	103	6860	6860	150	150	9976	9976

* 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.