

Fecha de Publicación: 4 de julio de 2019

Fecha de Información: 02 de julio 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\$2403.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	629.9	332.1	181.0	475.3	48.1	51.6	103.0
15-35	606.1	974.0	557.7	113.8	134.9	210.9	281.4
36-60	19.6	14.0	0.0	0.0	14.0	19.6	0.0
61-90	76.7	80.9	0.0	0.0	10.9	6.7	70.0
91-180	75.9	75.3	0.3	0.0	5.0	5.9	70.0
>180	23.0	20.1	0.0	10.8	20.1	12.2	0.0
Total	1431.2	1496.4	739.0	599.9	233.0	307.0	524.4

* 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	3.0 %	2.8 %	2.3 %	2.5 %
15-35	2.9 %	2.7 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	3.3 %	2.4 %	2.8 %
61-90	2.6 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.6 %	2.0 %	2.4 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
Total	2.8 %	2.7 %	2.4 %	2.6 %

*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	1 al 5 de julio				8 al 12 de julio				15 al 19 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	75	4309	4420	33	121	5709	6243	20	163	3724	4325
Intragrupa y off-shore***	0	0	2521	1810	0	0	2910	1730	0	0	1949	1098
Otros	75	31	518	1119	121	33	1601	2247	163	20	1296	1546
Total	106	106	7349	7349	154	154	10220	10220	184	184	6969	6969

* 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.