

Fecha de Publicación: 5 de julio de 2019

Fecha de Información: 03 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\$3059.9 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	440.9	717.2	266.0	183.0	238.2	44.9	213.0
15-35	662.3	612.9	281.7	341.0	91.8	81.9	239.5
36-60	124.5	74.5	0.0	0.0	74.5	124.5	0.0
61-90	411.6	129.9	113.0	200.0	6.9	201.6	10.0
91-180	48.8	117.4	40.0	0.0	37.4	8.8	40.0
>180	34.1	188.1	175.2	19.0	12.9	15.1	0.0
Total	1722.4	1840.0	875.9	743.0	461.7	476.9	502.5

* 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	2.9 %	2.9 %	1.8 %	2.6 %
15-35	2.8 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
36-60	-	2.4 %	2.4 %	2.4 %
61-90	2.6 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.5 %	2.4 %	2.2 %	2.5 %
>180	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
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**	27	80	4583	4525	34	123	5755	6702	20	165	3902	4545
Intragrupa y off-shore***	0	0	2531	1983	0	0	3132	1730	0	0	2016	1108
Otros	80	27	543	1150	123	34	1809	2263	165	20	1301	1567
Total	107	107	7657	7657	156	156	10695	10695	185	185	7219	7219

* 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.