

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2019

Fecha de Información: 04 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\$201.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	52.0	37.2	0.0	0.0	1.2	16.0	36.0
15-35	74.5	96.3	35.0	11.5	1.3	3.0	60.0
36-60	3.6	4.3	0.0	0.0	4.3	3.6	0.0
61-90	5.1	1.6	0.0	0.0	1.6	5.1	0.0
91-180	0.3	19.6	0.0	0.0	19.6	0.3	0.0
>180	1.1	2.1	0.0	0.0	2.1	1.1	0.0
Total	136.6	161.1	35.0	11.5	30.1	29.1	96.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.5 %	7.1 %	2.9 %	2.7 %
15-35	2.8 %	3.1 %	2.9 %	2.9 %
36-60	-	3.1 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	3.1 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.8 %
>180	-	2.7 %	2.2 %	2.5 %
Total	2.7 %	3.1 %	2.8 %	2.8 %

*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	4603	4523	34	124	5772	6720	21	165	3930	4562
Intragruppo y off-shore***	0	0	2531	1983	0	0	3132	1730	0	0	2016	1108
Otros	80	27	541	1170	124	34	1809	2263	165	21	1301	1577
Total	106	106	7675	7675	158	158	10713	10713	186	186	7247	7247

* 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 intragruppo.