

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2019

Fecha de Información: 05 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\$1570.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	354.3	347.0	170.6	200.3	40.3	18.0	136.1
15-35	458.0	411.1	219.5	170.2	51.2	147.4	140.4
36-60	74.3	97.9	0.0	0.0	97.9	74.3	0.0
61-90	9.6	9.7	0.0	5.0	9.7	4.6	0.0
91-180	7.9	14.7	5.0	0.0	9.7	7.9	0.0
>180	59.3	52.8	0.0	0.0	2.8	9.3	50.0
Total	963.5	933.1	395.1	375.5	211.5	261.5	326.5

* 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	3.0 %	2.8 %	2.8 %	2.9 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.4 %	2.7 %
36-60	-	2.7 %	2.4 %	2.6 %
61-90	-	2.8 %	2.4 %	2.6 %
91-180	-	2.9 %	1.4 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.6 %	2.0 %	2.2 %
Total	2.8 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %

*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	79	4603	4523	37	125	6050	6913	21	165	4002	4715
Intragrupa y off-shore***	0	0	2531	1983	0	0	3210	1917	0	0	2108	1121
Otros	79	27	541	1170	125	37	1835	2266	165	21	1313	1587
Total	106	106	7676	7676	161	161	11095	11095	186	186	7423	7423

* 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.