

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2019

Fecha de Información: 08 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\$1514.9 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	209.9	120.9	38.4	143.5	36.5	20.4	46.0
15-35	505.6	475.4	226.5	195.3	51.9	113.3	197.0
36-60	153.4	208.3	130.0	10.0	57.3	122.4	21.0
61-90	3.0	6.0	0.0	0.0	6.0	3.0	0.0
91-180	43.5	85.9	30.0	0.0	20.9	8.5	35.0
>180	0.2	1.7	0.0	0.0	1.7	0.2	0.0
Total	915.7	898.2	424.9	348.8	174.3	267.9	299.0

* 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	2.9 %	3.1 %	2.0 %	2.4 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
36-60	2.8 %	2.7 %	2.7 %	2.7 %
61-90	-	3.0 %	2.6 %	2.9 %
91-180	2.5 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
>180	-	2.7 %	2.1 %	2.6 %
Total	2.9 %	2.8 %	2.6 %	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	8 al 12 de julio				15 al 19 de julio				22 al 26 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	126	6216	6994	22	165	4037	4754	56	116	2766	2887
Intragrupa y off-shore***	0	0	3249	2054	0	0	2108	1127	0	0	1586	979
Otros	126	37	1849	2265	165	22	1336	1600	116	56	490	976
Total	163	163	11313	11313	187	187	7481	7481	172	172	4842	4842

* 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.