

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2019

Fecha de Información: 09 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\$1967.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	324.1	277.3	98.0	144.5	30.3	30.6	149.0
15-35	714.9	713.9	305.6	191.0	90.3	205.9	318.0
36-60	38.7	41.2	0.0	0.0	41.2	38.7	0.0
61-90	92.1	88.0	12.1	15.6	55.9	56.5	20.0
91-180	3.8	43.2	0.0	0.0	43.2	3.8	0.0
>180	107.6	44.4	5.0	60.3	4.4	12.3	35.0
Total	1281.2	1208.0	420.7	411.4	265.3	347.8	522.0

* 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	3.3 %	3.4 %	2.4 %	3.0 %
15-35	3.0 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	3.0 %	2.9 %	2.9 %
61-90	2.8 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	2.6 %	0.4 %	2.4 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
Total	3.0 %	3.0 %	2.6 %	2.9 %

*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**	36	122	6473	7175	22	165	4096	4830	55	129	2843	2987
Intragrupa y off-shore***	0	0	3324	2199	0	0	2120	1127	0	0	1617	982
Otros	122	36	1855	2279	165	22	1350	1609	129	55	499	990
Total	159	159	11653	11653	187	187	7566	7566	183	183	4960	4960

* 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.