

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2019

Fecha de Información: 11 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\$2188.8 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	462.8	289.9	156.1	352.8	49.3	25.6	84.5
15-35	712.4	648.4	422.8	356.8	28.6	158.6	197.0
36-60	102.7	50.1	1.5	3.0	48.5	99.7	0.0
61-90	14.3	26.6	5.4	0.0	21.2	14.3	0.0
91-180	38.1	100.5	65.0	20.0	20.5	3.1	15.0
>180	30.3	29.4	0.0	0.0	9.4	10.3	20.0
Total	1360.6	1144.8	650.8	732.6	177.4	311.5	316.5

* 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	2.7 %	3.2 %	2.7 %	2.8 %
15-35	2.8 %	3.0 %	2.8 %	2.9 %
36-60	-	3.2 %	2.9 %	3.0 %
61-90	-	2.7 %	2.3 %	2.6 %
91-180	2.5 %	2.6 %	2.3 %	2.6 %
>180	2.3 %	2.8 %	2.2 %	2.4 %
Total	2.7 %	3.0 %	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.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	29	125	7354	7209	26	164	4310	4965	59	130	2971	3314
Intragruppo y off-shore***	0	0	3346	3062	0	0	2192	1291	0	0	1856	1033
Otros	125	29	1858	2287	164	26	1393	1640	130	59	520	1001
Total	154	154	12558	12558	189	189	7896	7896	189	189	5348	5348

* 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.