

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2019

Fecha de Información: 12 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\$2188.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	381.5	239.9	94.0	246.0	19.9	9.5	126.0
15-35	496.6	691.3	476.3	252.5	49.0	78.1	166.0
36-60	75.4	88.8	25.0	0.0	63.8	75.4	0.0
61-90	150.9	25.3	0.0	150.0	25.3	0.9	0.0
91-180	21.2	150.4	100.0	0.0	30.4	1.2	20.0
>180	80.4	143.5	80.0	35.0	18.5	0.4	45.0
Total	1206.0	1339.1	775.3	683.5	206.9	165.5	357.0

* 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	2.8 %	1.9 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.7 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.9 %	2.8 %	2.9 %
61-90	-	2.7 %	2.4 %	2.7 %
91-180	2.5 %	2.7 %	2.1 %	2.6 %
>180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.4 %
Total	2.7 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %

*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	115	4592	5132	60	134	3070	3382
Intragruppo y off-shore***	0	0	3346	3062	0	0	2244	1462	0	0	1898	1109
Otros	125	29	1858	2287	115	26	1403	1645	134	60	526	1003
Total	154	154	12558	12558	141	141	8239	8239	194	194	5494	5494

* 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.