

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2019

Fecha de Información: 19 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\$1909.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	298.8	256.6	146.0	152.0	38.6	74.8	72.0
15-35	588.8	556.2	237.3	296.0	38.7	12.6	280.3
36-60	173.6	159.5	0.0	0.0	114.5	128.6	45.0
61-90	55.4	72.8	0.0	0.0	17.8	0.4	55.0
91-180	6.2	102.6	60.7	0.0	37.0	1.2	5.0
>180	87.9	43.8	0.0	45.9	8.8	7.0	35.0
Total	1210.7	1191.4	443.9	493.9	255.3	224.6	492.3

* 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	2.5 %	2.6 %	2.3 %	2.4 %
15-35	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
36-60	2.4 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.4 %	2.9 %	2.0 %	2.5 %
91-180	2.3 %	2.7 %	2.0 %	2.6 %
>180	2.3 %	2.6 %	2.2 %	2.3 %
Total	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %

*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	15 al 19 de julio				22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	121	5210	5278	63	146	3871	4049	13	108	3739	4784
Intragrupa y off-shore***	0	0	2384	2050	0	0	2194	1531	0	0	2473	1136
Otros	121	27	1403	1664	146	63	617	1102	108	13	909	1202
Total	148	148	8997	8992	209	209	6681	6681	122	122	7121	7121

* 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.