

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2019

Fecha de Información: 23 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\$1688.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	466.3	508.1	150.5	176.5	77.6	9.8	280.0
15-35	332.3	204.1	136.5	190.2	12.3	86.8	55.3
36-60	172.5	53.3	0.0	0.0	53.3	172.5	0.0
61-90	72.2	83.2	0.0	0.0	68.2	57.2	15.0
91-180	1.0	11.1	0.0	0.0	11.1	1.0	0.0
>180	58.5	121.1	70.0	10.7	6.1	2.9	45.0
Total	1102.8	980.9	357.0	377.3	228.6	330.2	395.3

* 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 %	2.2 %	1.8 %	2.2 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	2.3 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
91-180	-	2.3 %	1.4 %	2.2 %
>180	2.3 %	2.3 %	2.2 %	2.3 %
Total	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %

*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	22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	60	154	4365	4378	14	108	4066	5157	5	119	3821	4080
Intragrupa y off-shore***	0	0	2345	1839	0	0	2535	1203	0	0	2089	1355
Otros	154	60	616	1108	108	14	985	1226	119	5	477	952
Total	213	213	7326	7326	122	122	7586	7586	124	124	6387	6387

* 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.