

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2019

Fecha de Información: 26 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\$2016.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	352.4	197.7	109.0	257.3	6.7	13.1	82.0
15-35	573.3	545.9	341.5	378.0	85.8	76.7	118.6
36-60	7.8	4.1	0.0	0.0	4.1	7.8	0.0
61-90	155.3	53.1	20.0	0.0	2.6	124.8	30.5
91-180	19.8	57.2	0.0	0.0	57.2	19.8	0.0
>180	26.6	264.1	253.0	10.0	1.1	6.6	10.0
Total	1135.2	1122.1	723.5	645.3	157.6	248.8	241.1

* 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	2.4 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.4 %	2.3 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.6 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.3 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
91-180	-	2.4 %	2.1 %	2.3 %
>180	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
Total	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %

*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**	58	151	4886	4597	17	112	4498	5429	9	130	4041	4310
Intragrupa y off-shore***	0	0	2511	2295	0	0	2644	1510	0	0	2225	1480
Otros	151	58	611	1116	112	17	1065	1269	130	9	497	972
Total	210	210	8008	8008	129	129	8207	8207	138	138	6762	6762

* 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.