

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2019

Fecha de Información: 10 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\$3154.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	750.7	187.3	160.1	718.0	16.2	21.6	11.0
15-35	794.8	1004.4	745.6	315.7	129.8	350.2	129.0
36-60	39.9	62.2	0.0	0.0	62.2	39.9	0.0
61-90	89.2	190.7	121.8	0.0	68.9	89.2	0.0
91-180	25.9	161.6	120.0	0.0	16.6	0.9	25.0
>180	11.4	11.7	0.0	0.0	1.7	1.4	10.0
Total	1711.9	1617.9	1147.6	1033.7	295.4	503.2	175.0

* 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	
3-14	3.0 %	3.1 %	2.8 %	2.8 %
15-35	3.1 %	3.2 %	3.0 %	3.1 %
36-60	-	3.0 %	2.8 %	2.9 %
61-90	-	3.0 %	2.8 %	2.9 %
91-180	2.6 %	2.6 %	2.2 %	2.6 %
>180	2.3 %	2.6 %	2.1 %	2.4 %
Total	3.0 %	3.1 %	2.9 %	3.0 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$. 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**	31	124	7164	7186	25	163	4137	4864	57	129	2863	3149
Intragrupo y off-shore***	0	0	3329	2879	0	0	2140	1154	0	0	1769	992
Otros	124	31	1857	2284	163	25	1364	1623	129	57	502	993
Total	155	155	12350	12350	188	188	7642	7642	186	186	5135	5135

* 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.