

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2019

Fecha de Información: 22 de julio de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1933.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	392.1	308.5	136.0	202.3	8.5	25.8	164.0
15-35	488.6	468.2	249.0	220.0	47.7	97.1	171.5
36-60	195.0	94.6	0.0	21.1	94.6	173.9	0.0
61-90	11.1	5.4	0.0	0.0	5.4	11.1	0.0
91-180	50.3	222.0	100.1	0.0	72.0	0.3	50.0
>180	81.9	1.6	0.0	80.0	1.6	1.9	0.0
Total	1219.0	1100.2	485.1	523.4	229.7	310.0	385.5

* 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	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
15-35	2.4 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
36-60	-	2.4 %	2.4 %	2.4 %
61-90	-	3.4 %	2.3 %	2.7 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
>180	-	0.8 %	2.3 %	2.2 %
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

Sectores	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	153	4114	4185	13	108	3853	4919	5	119	3819	3997
Intragrupo y off-shore***	0	0	2270	1710	0	0	2533	1156	0	0	2006	1355
Otros	153	60	618	1107	108	13	910	1221	119	5	476	949
Total	213	213	7002	7002	122	122	7296	7296	124	124	6300	6300

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.