

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1407.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	279.8	99.4	14.8	175.8	16.6	36.0	68.0
15-35	315.2	429.9	150.7	47.0	61.8	50.7	217.5
36-60	328.2	141.5	0.0	0.0	141.5	328.2	0.0
61-90	6.3	5.8	1.0	0.0	4.8	6.3	0.0
91-180	2.4	20.0	11.3	0.0	8.7	2.4	0.0
>180	37.6	27.1	20.0	17.7	7.1	19.9	0.0
Total	969.5	723.7	197.7	240.5	240.5	443.5	285.5

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.5 %	0.5 %	2.2 %	2.1 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	2.8 %	2.7 %	2.7 %
61-90	-	2.8 %	2.4 %	2.6 %
91-180	-	2.6 %	2.4 %	2.6 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
Total	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	26	114	4831	5198	60	135	3108	3410	13	94	2922	3977
Intragruppo y off-shore***	0	0	2259	1628	0	0	1898	1119	0	0	2185	868
Otros	114	26	1410	1676	135	60	529	1007	94	13	716	979
Total	141	141	8501	8501	195	195	5535	5535	107	107	5824	5824

* 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.