

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2019

Fecha de Información: 17 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\$2769.5 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	741.8	458.1	114.0	380.8	103.1	120.0	241.0
15-35	1000.5	1152.9	376.0	163.0	93.9	154.5	683.0
36-60	140.2	88.2	0.0	0.0	88.2	140.2	0.0
61-90	10.4	50.1	10.0	0.0	30.1	0.4	10.0
91-180	10.1	32.6	2.0	0.0	20.6	0.1	10.0
>180	11.3	17.2	0.0	10.1	17.2	1.2	0.0
Total	1914.3	1799.2	502.0	553.9	353.2	416.4	944.0

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.6 %	2.7 %	2.1 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.5 %	2.6 %	2.6 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	2.4 %	2.6 %	2.0 %	2.6 %
91-180	2.4 %	2.6 %	2.1 %	2.6 %
>180	-	2.5 %	2.2 %	2.5 %
Total	2.3 %	2.6 %	2.3 %	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	123	5130	5263	61	138	3552	3871	13	92	3417	4392
Intragruppo y off-shore***	0	0	2381	1970	0	0	2072	1273	0	0	2328	1032
Otros	123	26	1390	1664	138	61	609	1089	92	13	792	1115
Total	148	148	8902	8897	199	199	6233	6233	104	104	6538	6538

* 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.