

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1933.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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 | 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 | 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 |
| Intragrupa 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.