

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2019

Fecha de Información: 24 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\$1945.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	333.4	235.4	135.2	229.5	20.2	23.9	80.0
15-35	479.4	778.0	446.7	62.7	49.3	134.7	282.0
36-60	268.0	126.6	0.0	0.0	126.6	268.0	0.0
61-90	17.3	4.3	0.0	0.0	4.3	17.3	0.0
91-180	14.8	15.9	0.0	0.0	10.9	9.8	5.0
>180	29.7	29.9	0.0	7.5	9.9	2.1	20.0
Total	1142.6	1190.1	581.9	299.7	221.3	455.9	387.0

* 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	2.4 %	2.5 %	1.7 %	2.0 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-	2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	-	2.6 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
Total	-	2.4 %	2.1 %	2.3 %

*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

Sector	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	157	4607	4473	16	108	4152	5211	6	129	3829	4194
Intragrupa y off-shore***	0	0	2401	2032	0	0	2555	1240	0	0	2189	1355
Otros	157	60	610	1113	108	16	989	1245	129	6	485	955
Total	217	217	7618	7618	124	124	7696	7696	135	135	6503	6503

* 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.