

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2019

Fecha de Información: 25 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\$2096.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	481.2	260.5	125.0	401.2	83.4	28.0	52.1
15-35	562.2	463.3	314.8	359.0	31.1	85.7	117.5
36-60	102.4	41.6	1.7	0.0	39.9	102.4	0.0
61-90	54.9	212.3	200.5	0.0	1.8	44.9	10.0
91-180	4.3	45.4	0.0	1.7	45.4	2.7	0.0
>180	13.7	44.8	30.0	0.0	4.8	3.7	10.0
Total	1218.6	1067.9	671.9	761.8	206.4	267.2	189.6

* 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 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %
61-90	2.3 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
91-180	-	3.0 %	2.0 %	2.9 %
>180	2.2 %	3.1 %	1.6 %	2.3 %
Total	-	2.5 %	2.3 %	2.4 %

*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**	58	152	4886	4595	17	107	4231	5286	7	128	3959	4256
Intragrupa y off-shore***	0	0	2511	2295	0	0	2555	1299	0	0	2204	1434
Otros	152	58	610	1116	107	17	1062	1264	128	7	495	968
Total	211	211	8006	8006	124	124	7849	7849	135	135	6658	6658

* 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.