

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2019

Fecha de Información: 29 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\$2430.1 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	430.7	340.5	208.0	263.7	12.8	47.4	119.7
15-35	733.5	485.2	289.0	419.5	86.2	204.1	110.0
36-60	152.4	122.6	26.8	0.0	77.8	134.4	18.0
61-90	3.4	1.0	0.0	0.0	1.0	3.4	0.0
91-180	52.3	37.9	0.0	0.0	12.9	27.3	25.0
>180	126.1	267.1	210.0	55.4	7.1	20.7	50.0
Total	1498.4	1254.3	733.8	738.6	197.9	437.2	322.6

* 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	2.3 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	2.2 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
61-90	-	2.4 %	1.8 %	2.0 %
91-180	2.2 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
Total	-	2.5 %	2.2 %	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	29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	112	4640	5586	17	130	4310	4480	16	125	3902	3588
Intragrupa y off-shore***	0	0	2745	1594	0	0	2315	1660	0	0	1906	1193
Otros	112	13	1085	1289	130	17	494	979	125	16	712	1738
Total	125	125	8470	8470	147	147	7119	7119	141	141	6520	6520

* 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.