

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2019

Fecha de Información: 30 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\$2478.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	422.2	111.7	76.5	372.5	12.2	26.7	23.0
15-35	561.6	1032.5	770.0	283.1	121.6	137.5	141.0
36-60	248.4	11.6	0.0	138.0	6.6	105.4	5.0
61-90	10.0	17.9	8.5	0.0	9.4	10.0	0.0
91-180	33.5	134.0	70.1	0.0	44.0	13.5	20.0
>180	28.7	64.3	50.1	10.0	5.3	9.7	9.0
Total	1304.4	1372.1	975.1	803.6	199.0	302.8	198.0

* 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	2.3 %	3.0 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.3 %	1.9 %	2.2 %
91-180	2.2 %	2.2 %	1.1 %	2.1 %
>180	2.2 %	2.4 %	1.8 %	2.1 %
Total	-	2.3 %	1.9 %	2.1 %

*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	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	5017	5620	18	132	4343	4502	16	126	3937	3738
Intragruppo y off-shore***	0	0	2761	1946	0	0	2321	1675	0	0	2043	1218
Otros	112	13	1090	1301	132	18	500	987	126	16	724	1749
Total	125	125	8867	8867	149	149	7164	7164	142	142	6705	6705

* 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.