

Fecha de Publicación: 2 de agosto de 2019

Fecha de Información: 31 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\$2078.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	498.8	171.3	67.5	400.5	24.4	18.9	79.4
15-35	469.4	1041.1	754.0	122.5	53.5	113.2	233.7
36-60	139.6	9.5	0.0	50.0	9.5	89.6	0.0
61-90	2.1	9.9	0.0	0.0	9.9	2.1	0.0
91-180	9.9	11.6	0.0	0.0	11.6	9.9	0.0
>180	24.4	4.2	0.0	20.0	4.2	4.4	0.0
Total	1144.2	1247.6	821.5	593.0	113.0	238.2	313.1

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.3 %	2.0 %	2.3 %
36-60	-	2.8 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.4 %	1.8 %	2.3 %
91-180	-	2.4 %	1.5 %	1.9 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.2 %
Total	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %

*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 intragruppo.

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	119	5398	5697	19	182	4413	4505	17	129	4013	3817
Intragruppo y off-shore***	0	0	2783	2277	0	0	2347	1723	0	0	2074	1239
Otros	119	13	1096	1303	182	19	467	997	129	17	730	1762
Total	132	132	9277	9277	200	200	7226	7226	146	146	6818	6818

* 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.