

Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2019

Fecha de Información: 01 de agosto 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\$3487.9 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	443.8	547.7	242.8	305.0	187.8	21.6	117.2
15-35	707.5	746.0	637.5	489.0	64.5	174.5	44.0
36-60	111.1	71.1	7.0	20.0	64.1	91.1	0.0
61-90	288.9	356.7	245.0	150.0	1.7	28.9	110.0
91-180	142.5	245.6	150.0	0.0	5.6	52.5	90.0
>180	72.6	145.4	110.0	30.4	5.4	12.2	30.0
Total	1766.5	2112.6	1392.3	994.4	329.2	380.9	391.2

* 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 %	2.9 %	1.8 %	2.4 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	2.3 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.3 %	2.5 %	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.

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**	14	121	5601	5804	19	185	4495	4666	18	128	4164	4089
Intragruppo y off-shore***	0	0	2846	2440	0	0	2507	1806	0	0	2094	1298
Otros	121	14	1101	1303	185	19	467	997	128	18	906	1777
Total	135	135	9547	9547	204	204	7469	7469	146	146	7165	7165

* 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.