

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2019

Fecha de Información: 02 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\$2238.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	187.2	263.6	233.0	125.2	5.7	37.0	25.0
15-35	595.2	780.9	595.5	402.1	106.6	114.4	78.8
36-60	53.8	6.0	0.0	0.0	6.0	53.8	0.0
61-90	38.1	9.1	0.0	0.0	4.1	33.1	5.0
91-180	30.0	24.9	22.4	6.0	2.5	24.0	0.0
>180	169.8	198.7	188.0	125.5	0.7	34.3	10.0
Total	1074.2	1283.2	1038.9	658.8	125.5	296.6	118.8

* 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	2.5 %	2.7 %	1.2 %	1.9 %
15-35	2.5 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
36-60	-	2.7 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.5 %	2.1 %	2.1 %
91-180	-	2.4 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.3 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.5 %	2.4 %	1.9 %	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 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	120	5601	5807	19	186	4579	4776	21	128	4264	4239
Intragruppo y off-shore***	0	0	2846	2440	0	0	2607	1869	0	0	2226	1360
Otros	120	14	1104	1303	186	19	472	1013	128	21	904	1794
Total	134	134	9550	9550	205	205	7658	7658	150	150	7394	7394

* 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.