

Fecha de Publicación: 8 de agosto de 2019

Fecha de Información: 05 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\$3177.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	180.4	597.7	129.0	69.5	401.7	43.9	67.0
15-35	663.3	1160.7	775.8	239.9	156.6	195.1	228.3
36-60	60.1	40.1	10.0	0.0	5.1	35.1	25.0
61-90	425.7	10.2	0.0	0.0	10.2	425.7	0.0
91-180	79.9	144.6	115.5	20.0	14.2	44.9	15.0
>180	147.9	53.9	1.2	2.1	0.7	93.8	52.0
Total	1557.3	2007.3	1031.5	331.4	588.5	838.6	387.3

* 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 %	2.5 %	1.2 %	2.4 %
15-35	2.5 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %
36-60	2.5 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
61-90	-	2.4 %	2.4 %	2.4 %
91-180	2.5 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.5 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
Total	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %

*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	5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	193	4692	4892	24	128	4328	4723	11	135	2848	3160
Intragruppo y off-shore***	0	0	2679	1937	0	0	2283	1362	0	0	1571	1065
Otros	193	19	475	1018	128	24	1304	1830	135	11	607	801
Total	212	212	7847	7847	151	151	7915	7915	146	146	5026	5026

* 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.