

Fecha de Publicación: 9 de agosto de 2019

Fecha de Información: 06 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\$1826.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.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	174.1	406.6	323.5	96.0	20.1	15.1	63.0
15-35	247.4	506.6	428.0	147.0	28.7	50.4	50.0
36-60	73.5	42.8	30.0	0.0	12.8	73.5	0.0
61-90	332.3	27.9	0.0	276.0	17.9	46.3	10.0
91-180	51.0	28.7	0.0	30.0	28.7	21.0	0.0
>180	44.7	17.1	10.0	20.0	3.8	21.4	3.3
Total	923.0	1029.7	791.5	569.0	112.0	227.8	126.3

* 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	2.4 %	2.7 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
36-60	-	3.0 %	2.4 %	2.5 %
61-90	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
91-180	-	2.7 %	2.2 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
Total	2.5 %	2.7 %	2.4 %	2.5 %

*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	4803	4924	25	130	4387	5088	12	136	2851	3196
Intragruppo y off-shore***	0	0	2695	2033	0	0	2584	1362	0	0	1600	1065
Otros	193	19	485	1026	130	25	1311	1833	136	12	613	804
Total	212	212	7983	7983	154	154	8283	8283	148	148	5065	5065

* 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.