

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2019

Fecha de Información: 08 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\$2370.4 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	481.5	304.1	87.2	300.1	51.6	16.2	165.3
15-35	867.0	963.1	679.3	410.5	30.8	203.5	253.0
36-60	24.8	12.9	0.0	0.0	6.9	18.8	6.0
61-90	38.6	33.0	2.0	0.7	31.0	37.9	0.0
91-180	15.0	27.8	0.0	2.0	27.8	13.0	0.0
>180	15.6	11.1	0.0	10.0	11.1	5.6	0.0
Total	1442.6	1352.0	768.5	723.3	159.2	295.1	424.3

* 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	2.6 %	2.6 %	1.8 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.3 %	2.6 %
36-60	2.5 %	2.7 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	3.2 %	2.4 %	2.8 %
91-180	-	2.6 %	2.3 %	2.5 %
>180	-	2.7 %	2.1 %	2.5 %
Total	2.6 %	2.7 %	2.2 %	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	198	4902	4940	26	130	4704	5308	13	137	2917	3261
Intragruppo y off-shore***	0	0	2695	2122	0	0	2639	1540	0	0	1633	1098
Otros	198	19	492	1028	130	26	1342	1837	137	13	624	816
Total	217	217	8089	8089	156	156	8685	8685	150	150	5174	5174

* 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.