

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2019

Fecha de Información: 12 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\$1524.4 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	244.6	168.1	58.9	115.9	13.2	32.7	96.0
15-35	516.6	514.5	422.0	319.3	19.5	124.3	73.0
36-60	23.0	154.0	140.0	0.0	14.0	23.0	0.0
61-90	12.6	0.7	0.0	0.0	0.7	12.6	0.0
91-180	4.7	31.9	20.0	0.0	11.9	4.7	0.0
>180	22.5	0.2	0.0	10.0	0.2	12.5	0.0
Total	824.0	869.4	640.9	445.2	59.5	209.8	169.0

* 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 %	2.8 %	1.7 %	2.2 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
36-60	-	2.7 %	2.4 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	2.4 %	2.4 %
91-180	-	2.5 %	2.2 %	2.5 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.3 %
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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	131	5417	5905	13	138	3377	3580	19	211	3689	4504
Intragruppo y off-shore***	0	0	2916	1910	0	0	1691	1162	0	0	2955	1767
Otros	131	26	1387	1904	138	13	711	1037	211	19	792	1165
Total	157	157	9720	9720	151	151	5779	5779	230	230	7436	7436

* 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.