

Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2019

Fecha de Información: 16 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\$1297.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	442.5	275.9	69.6	245.0	23.3	14.5	183.0
15-35	429.7	485.7	208.0	106.4	50.4	96.1	227.3
36-60	0.4	6.2	0.0	0.0	6.2	0.4	0.0
61-90	1.5	7.1	0.0	0.0	7.1	1.5	0.0
91-180	2.1	18.4	0.0	1.6	18.4	0.5	0.0
>180	37.5	0.9	0.0	35.3	0.9	2.2	0.0
Total	913.7	794.2	277.6	388.3	106.3	115.2	410.3

* 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 %	2.7 %	2.2 %	2.5 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
36-60	-	3.9 %	0.8 %	3.7 %
61-90	-	2.7 %	2.1 %	2.6 %
91-180	-	2.8 %	2.5 %	2.8 %
>180	-	2.7 %	2.6 %	2.6 %
Total	2.6 %	2.6 %	2.4 %	2.6 %

*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	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**	23	139	6216	6117	16	145	3806	3917	20	212	4328	4931
Intragruppo y off-shore***	0	0	3010	2575	0	0	1834	1359	0	0	2996	2103
Otros	139	23	1409	1943	145	16	743	1107	212	20	978	1268
Total	162	162	10635	10635	162	162	6384	6384	232	232	8302	8302

* 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.