

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2019

Fecha de Información: 20 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\$1686.9 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	447.2	235.2	3.5	208.8	27.7	34.4	204.0
15-35	623.9	635.0	248.6	250.0	102.4	89.9	284.0
36-60	17.5	31.6	12.0	0.0	7.6	5.5	12.0
61-90	72.2	55.0	0.0	0.0	55.0	72.2	0.0
91-180	0.3	45.5	31.3	0.0	14.2	0.3	0.0
>180	0.2	23.3	20.1	0.0	3.2	0.2	0.0
Total	1161.3	1025.6	315.5	458.8	210.1	202.5	500.0

* 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 %	3.8 %	2.4 %	2.6 %
15-35	2.6 %	2.7 %	2.6 %	2.6 %
36-60	2.5 %	3.0 %	2.3 %	2.6 %
61-90	-	2.5 %	2.4 %	2.4 %
91-180	-	2.6 %	2.4 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.3 %	2.6 %
Total	2.6 %	2.7 %	2.5 %	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	19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	150	4129	4087	25	213	4411	4983	11	65	3220	3727
Intragruppo y off-shore***	0	0	1838	1547	0	0	2996	2124	0	0	2498	1556
Otros	150	47	755	1088	213	25	991	1291	65	11	490	925
Total	198	198	6722	6722	239	239	8398	8398	76	76	6207	6207

* 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.