

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2019

Fecha de Información: 21 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\$2188.3 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	551.7	439.2	119.7	256.0	69.5	45.7	250.0
15-35	704.8	718.3	306.4	308.2	68.0	52.6	344.0
36-60	105.9	103.6	0.0	0.0	103.6	105.9	0.0
61-90	8.7	20.8	0.0	2.0	20.8	6.7	0.0
91-180	18.8	38.6	10.0	0.0	28.6	18.8	0.0
>180	59.5	62.3	5.0	0.0	7.3	9.5	50.0
Total	1449.5	1382.8	441.1	566.2	297.7	239.2	644.0

* 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	2.5 %	3.0 %	2.2 %	2.5 %
15-35	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	2.4 %	2.6 %
91-180	-	2.7 %	2.5 %	2.6 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
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	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**	48	205	4382	4256	26	220	4590	5157	11	66	3342	3837
Intragruppo y off-shore***	0	0	1914	1750	0	0	3040	2177	0	0	2500	1556
Otros	205	48	803	1093	220	26	1036	1331	66	11	478	927
Total	253	253	7099	7099	246	246	8665	8665	77	77	6320	6320

* 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.