

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2019

Fecha de Información: 23 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\$2316.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	541.2	117.9	36.0	446.6	16.4	29.1	65.5
15-35	791.7	995.4	649.6	426.0	71.8	91.7	274.0
36-60	17.5	27.0	8.2	0.0	3.8	2.5	15.0
61-90	15.0	21.7	20.0	0.0	1.7	15.0	0.0
91-180	14.7	35.9	20.0	4.0	5.9	0.7	10.0
>180	78.2	89.6	20.0	8.6	4.6	4.6	65.0
Total	1458.3	1287.5	753.8	885.2	104.2	143.6	429.5

* 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	2.1 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	2.4 %	2.7 %	1.2 %	2.3 %
61-90	-	2.4 %	2.3 %	2.4 %
91-180	2.4 %	2.5 %	2.5 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.6 %
Total	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %

*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	192	4464	4307	28	226	5173	5324	11	67	3526	3933
Intragruppo y off-shore***	0	0	1916	1781	0	0	3060	2608	0	0	2519	1677
Otros	192	47	810	1102	226	28	1049	1351	67	11	503	939
Total	239	239	7191	7191	255	255	9283	9283	79	79	6549	6549

* 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.