

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2019

Fecha de Información: 13 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\$2285.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 588.8 | 131.8 | 31.2 | 486.4 | 33.4 | 35.2 | 67.2 |
| 15-35 | 718.6 | 991.8 | 646.2 | 337.5 | 104.9 | 140.4 | 240.7 |
| 36-60 | 12.0 | 36.1 | 30.0 | 0.0 | 6.1 | 12.0 | 0.0 |
| 61-90 | 5.6 | 4.8 | 0.0 | 0.0 | 4.8 | 5.6 | 0.0 |
| 91-180 | 46.9 | 15.3 | 0.0 | 0.0 | 15.3 | 46.9 | 0.0 |
| >180 | 12.1 | 29.2 | 25.0 | 10.0 | 4.2 | 2.1 | 0.0 |
| Total | 1384.1 | 1209.1 | 732.4 | 833.9 | 168.8 | 242.3 | 307.9 |

* 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 | |
| 3-14 | 2.8 % | 3.0 % | 2.0 % | 2.2 % |
| 15-35 | 2.7 % | 2.7 % | 2.6 % | 2.7 % |
| 36-60 | - | 2.3 % | 1.7 % | 1.9 % |
| 61-90 | - | 2.6 % | 2.3 % | 2.4 % |
| 91-180 | - | 2.7 % | 2.3 % | 2.4 % |
| >180 | - | 2.6 % | 2.3 % | 2.5 % |
| Total | 2.7 % | 2.7 % | 2.3 % | 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 | 135 | 5976 | 5995 | 14 | 140 | 3404 | 3615 | 19 | 212 | 3788 | 4571 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2942 | 2394 | 0 | 0 | 1696 | 1164 | 0 | 0 | 2978 | 1820 |
| Otros | 135 | 26 | 1394 | 1924 | 140 | 14 | 731 | 1051 | 212 | 19 | 798 | 1173 |
| Total | 162 | 162 | 10313 | 10313 | 155 | 155 | 5830 | 5830 | 231 | 231 | 7564 | 7564 |

* 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.