

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2019

Fecha de Información: 14 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\$1780.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	304.3	152.1	67.0	158.5	20.6	81.2	64.5
15-35	628.5	707.2	281.0	188.0	127.8	142.1	298.4
36-60	72.9	110.6	40.0	0.0	70.6	72.9	0.0
61-90	7.8	7.1	0.0	0.0	7.1	7.8	0.0
91-180	67.8	44.1	15.0	36.2	14.1	16.6	15.0
>180	43.1	22.8	10.0	21.4	2.8	11.6	10.0
Total	1124.3	1043.8	413.0	404.2	242.9	332.2	387.9

* 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	2.7 %	2.1 %	2.4 %	2.4 %
15-35	2.6 %	2.8 %	2.5 %	2.7 %
36-60	-	2.6 %	2.5 %	2.5 %
61-90	-	2.7 %	2.3 %	2.5 %
91-180	2.5 %	2.8 %	2.0 %	2.4 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.3 %
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: ((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**	25	135	6187	6110	15	141	3460	3647	20	211	3926	4614
Intragrupo y off-shore***	0	0	3009	2553	0	0	1696	1164	0	0	2978	1873
Otros	135	25	1403	1937	141	15	737	1082	211	20	806	1223
Total	161	161	10600	10600	156	156	5893	5893	231	231	7710	7710

* 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.