

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2019

Fecha de Información: 26 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\$2092.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	304.3	141.2	54.2	202.0	27.0	42.3	60.0
15-35	1035.6	738.6	226.3	485.1	118.4	156.6	393.9
36-60	48.2	61.2	34.4	0.0	6.8	28.2	20.0
61-90	27.7	25.9	0.0	0.0	25.9	27.7	0.0
91-180	28.3	93.6	53.5	0.0	30.1	18.3	10.0
>180	51.8	69.5	15.0	0.0	4.5	1.8	50.0
Total	1495.9	1130.0	383.4	687.1	212.7	274.9	533.9

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	1.1 %	1.9 %	1.7 %
15-35	2.0 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	2.1 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
61-90	-	2.4 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.2 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.1 %	2.6 %
Total	2.1 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %

*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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	238	5294	5423	11	63	3682	3936	9	139	4261	4338
Intragruppo y off-shore***	0	0	3102	2663	0	0	2522	1824	0	0	2385	1471
Otros	238	29	1047	1357	63	11	504	948	139	9	784	1621
Total	267	267	9443	9443	75	75	6708	6708	149	149	7430	7430

* 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.