

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2019

Fecha de Información: 27 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\$3119.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	595.2	337.1	225.0	471.1	22.6	34.6	89.5
15-35	739.9	1161.7	383.1	187.8	458.3	231.8	320.3
36-60	23.3	36.5	30.0	0.0	1.5	18.3	5.0
61-90	342.3	7.6	0.0	0.0	7.6	342.3	0.0
91-180	191.6	174.4	0.6	14.5	3.8	7.1	170.0
>180	93.7	76.4	0.0	10.0	1.4	8.7	75.0
Total	1986.0	1793.7	638.7	683.4	495.2	642.8	659.8

* 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	1.8 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
61-90	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
91-180	2.2 %	2.4 %	1.5 %	2.1 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %

*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**	28	242	5682	5685	15	63	3879	3989	11	139	4281	4383
Intragruppo y off-shore***	0	0	3306	2993	0	0	2522	1955	0	0	2425	1481
Otros	242	28	1059	1369	63	15	512	969	139	11	783	1626
Total	271	271	10047	10047	78	78	6913	6913	149	149	7490	7490

* 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.