

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2019

Fecha de Información: 28 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\$2075.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	567.3	266.9	97.0	382.3	71.6	86.8	98.3
15-35	547.6	609.7	341.3	233.7	113.6	159.1	154.9
36-60	108.5	90.4	0.0	40.0	90.4	68.5	0.0
61-90	60.2	48.5	0.0	3.2	13.5	22.0	35.0
91-180	2.9	24.4	15.0	0.0	9.4	2.9	0.0
>180	16.2	20.8	13.9	3.9	7.0	12.3	0.0
Total	1302.7	1060.8	467.1	663.1	305.5	351.5	288.1

* 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	1.3 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.8 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	1.9 %	2.2 %
>180	-	2.7 %	2.4 %	2.5 %
Total	1.5 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	245	5942	5830	21	63	4133	4083	17	139	4382	4450
Intragruppo y off-shore***	0	0	3403	3212	0	0	2522	2104	0	0	2425	1494
Otros	245	29	1063	1366	63	21	576	1044	139	17	784	1647
Total	274	274	10408	10408	84	84	7231	7231	155	155	7592	7592

* 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.