

Fecha de Publicación: 3 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 30 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\$1025.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	238.4	244.7	80.2	109.5	45.9	10.3	118.5
15-35	357.7	310.1	70.4	153.8	84.0	48.3	155.6
36-60	5.0	9.2	0.0	0.0	9.2	5.0	0.0
61-90	22.7	50.5	0.0	0.0	50.5	22.7	0.0
91-180	12.9	16.4	0.0	1.2	16.4	11.7	0.0
>180	5.7	31.4	0.0	0.0	26.4	0.7	5.0
Total	642.4	662.2	150.7	264.5	232.3	98.7	279.2

* 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	1.4 %		1.8 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.3 %		1.6 %	1.2 %	1.4 %
36-60	-		2.4 %	1.1 %	2.0 %
61-90	-		2.0 %	1.5 %	1.9 %
91-180	-		2.5 %	1.6 %	2.1 %
>180	2.6 %		2.5 %	2.4 %	2.5 %
Total	1.4 %		1.9 %	1.3 %	1.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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	248	5992	5874	23	69	4433	4348	16	140	4640	4638
Intragrupo y off-shore***	0	0	3410	3239	0	0	2640	2279	0	0	2458	1607
Otros	248	28	1067	1355	69	23	624	1070	140	16	798	1651
Total	276	276	10469	10469	92	92	7696	7696	157	157	7897	7897

* 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.

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.