

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 18 de septiembre 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\$1957.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	601.3	246.5	47.0	403.6	138.0	136.2	61.5
15-35	320.4	512.9	393.9	156.7	45.2	89.9	73.8
36-60	0.9	9.8	0.0	0.0	9.8	0.9	0.0
61-90	206.3	82.9	0.0	130.0	57.9	51.3	25.0
91-180	1.7	25.6	20.0	0.0	5.6	1.7	0.0
>180	100.5	29.3	1.9	45.0	7.3	35.5	20.0
Total	1231.1	906.9	462.8	735.3	263.8	315.5	180.3

* 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	1.1 %	1.2 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.7 %	1.1 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-	1.8 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.3 %	2.1 %	2.1 %
Total	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %

*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	16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	182	8098	7027	21	121	4390	4710	16	158	2497	2760
Intragrupa y off-shore***	0	0	2777	3194	0	0	1927	1609	0	0	1131	862
Otros	182	29	1724	2378	121	21	1057	1054	158	16	460	466
Total	211	211	12599	12599	141	141	7374	7374	173	173	4088	4088

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