

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 02 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\$275.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	185.9	186.7	4.5	5.0	2.2	0.9	180.0
15-35	57.7	62.3	15.0	0.0	4.3	14.7	43.0
36-60	0.8	0.3	0.0	0.0	0.3	0.8	0.0
61-90	0.4	1.2	0.0	0.0	1.2	0.4	0.0
91-180	0.0	1.7	0.0	0.0	1.7	0.0	0.0
>180	0.1	1.1	0.0	0.0	1.1	0.1	0.0
Total	244.9	253.3	19.5	5.0	10.8	16.9	223.0

* 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	0.9 %	1.8 %	0.7 %	0.9 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.9 %	1.1 %	1.4 %
61-90	-	2.1 %	1.7 %	2.0 %
91-180	-	2.4 %	-	2.4 %
>180	-	2.5 %	2.1 %	2.5 %
Total	1.0 %	1.7 %	1.3 %	1.1 %

*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

Sector	2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	74	4594	4505	17	141	4645	4639	18	130	5684	5174
Intragrupa y off-shore***	0	0	2640	2279	0	0	2458	1612	0	0	2074	1862
Otros	74	22	616	1066	141	17	798	1652	129	18	1386	2109
Total	96	96	7850	7850	158	158	7902	7902	148	148	9144	9144

* 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.