

Fecha de Publicación: 5 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 03 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\$1954.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	545.2	513.9	238.6	328.5	141.3	82.7	134.0
15-35	515.4	503.5	108.9	72.4	110.7	159.1	283.9
36-60	39.2	54.5	0.0	0.0	29.5	14.2	25.0
61-90	127.7	13.7	0.0	0.0	13.7	127.7	0.0
91-180	13.3	42.7	0.0	12.5	42.7	0.8	0.0
>180	25.1	17.7	0.0	10.0	2.7	0.1	15.0
Total	1265.9	1146.0	347.5	423.4	340.6	384.6	457.9

* 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 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
61-90	-	2.2 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	2.1 %	2.3 %
>180	2.7 %	2.6 %	2.3 %	2.5 %
Total	1.5 %	1.4 %	1.5 %	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

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	4889	4718	17	141	4864	4795	19	130	5797	5421
Intragrupa y off-shore***	0	0	2802	2474	0	0	2524	1740	0	0	2084	1871
Otros	74	22	622	1121	141	17	814	1667	130	19	1536	2125
Total	96	96	8314	8314	158	158	8203	8203	149	149	9416	9416

* 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.