

Fecha de Publicación: 6 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 04 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\$2017.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	568.2	259.4	31.5	279.0	145.9	207.2	82.0
15-35	692.2	719.0	185.0	274.8	242.5	125.9	291.5
36-60	28.4	26.9	0.0	11.6	26.9	16.8	0.0
61-90	11.2	20.6	0.0	0.0	20.6	11.2	0.0
91-180	15.4	36.6	2.9	0.0	28.7	10.4	5.0
>180	15.0	8.2	0.0	10.0	3.2	0.0	5.0
Total	1330.4	1070.7	219.4	575.4	467.8	371.5	383.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	2.4 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.0 %	1.6 %	1.8 %
61-90	-	2.1 %	1.5 %	1.9 %
91-180	2.0 %	2.4 %	2.0 %	2.2 %
>180	2.3 %	2.6 %	2.3 %	2.4 %
Total	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %

*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	78	5089	4816	19	155	5122	4922	19	140	5978	5526
Intragruppo y off-shore***	0	0	2826	2600	0	0	2532	1883	0	0	2125	1891
Otros	78	22	634	1133	155	19	924	1772	140	19	1540	2226
Total	101	101	8549	8549	175	175	8578	8578	159	159	9643	9643

* 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 intragruppo.