

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 06 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\$1716.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	284.4	379.2	259.1	184.4	31.1	11.0	89.0
15-35	533.9	331.5	217.0	399.2	56.5	76.7	58.0
36-60	114.8	20.9	0.0	87.1	20.9	27.7	0.0
61-90	55.7	55.1	0.5	20.0	19.6	0.7	35.0
91-180	1.2	68.4	1.2	0.0	67.2	1.2	0.0
>180	41.4	31.7	4.4	18.3	7.3	3.0	20.0
Total	1031.3	886.8	482.2	709.0	202.6	120.3	202.0

* 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	1.4 %	1.3 %	1.3 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	2.8 %	1.4 %	1.8 %
61-90	1.8 %	2.3 %	1.6 %	1.9 %
91-180	-	2.3 %	1.7 %	2.3 %
>180	2.1 %	2.8 %	2.4 %	2.4 %
Total	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

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

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	23	82	5102	4902	23	161	5551	5357	19	148	6175	5690
Intragruppo y off-shore***	0	0	2899	2603	0	0	2932	2283	0	0	2128	1937
Otros	82	23	648	1143	161	23	948	1790	148	19	1573	2249
Total	104	104	8649	8649	184	184	9430	9430	168	168	9876	9876

* 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.