

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 11 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\$2026.1 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	349.1	300.0	103.0	144.0	98.4	106.5	98.7
15-35	704.7	802.6	386.5	220.8	33.3	101.1	382.9
36-60	122.2	33.3	0.0	0.0	13.3	102.2	20.0
61-90	0.6	15.1	0.0	0.0	15.1	0.6	0.0
91-180	127.9	98.2	20.0	40.0	8.2	17.9	70.0
>180	31.9	21.9	0.0	20.0	11.9	1.9	10.0
Total	1336.5	1271.1	509.5	424.8	180.1	330.2	581.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.3 %	1.0 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.6 %	1.4 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	3.0 %	0.8 %	2.9 %
91-180	1.8 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.4 %	1.4 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	118	6333	5939	26	147	6738	6105	18	127	3618	4320
Intragrupa y off-shore***	0	0	3306	2852	0	0	2180	2119	0	0	1867	1133
Otros	118	25	972	1820	147	26	1669	2363	127	18	848	880
Total	143	143	10611	10611	173	173	10587	10587	145	145	6334	6334

* 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.