

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 12 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\$1162.1 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	309.8	200.7	97.8	232.0	44.7	19.6	58.3
15-35	294.3	280.0	128.7	96.5	75.5	122.0	75.8
36-60	2.2	40.6	18.5	1.7	22.1	0.5	0.0
61-90	12.9	20.4	0.0	0.0	15.4	7.9	5.0
91-180	66.4	56.6	0.0	10.0	16.6	16.4	40.0
>180	50.7	26.4	0.0	30.0	6.4	0.7	20.0
Total	736.3	624.7	245.0	370.2	180.7	167.1	199.0

* 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	1.5 %	1.6 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.7 %	1.9 %	0.9 %	1.6 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.4 %	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	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**	24	121	6445	6102	24	146	6991	6139	17	132	3644	4371
Intragrupa y off-shore***	0	0	3446	2939	0	0	2176	2341	0	0	1879	1135
Otros	121	24	973	1821	146	24	1682	2369	132	17	874	892
Total	146	146	10863	10863	170	170	10849	10849	149	149	6398	6398

* 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.