

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 16 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\$1306.1 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	412.3	193.8	54.4	302.0	41.4	12.3	98.0
15-35	409.4	369.9	174.0	176.8	36.4	73.1	159.5
36-60	67.4	2.8	0.0	0.0	2.8	67.4	0.0
61-90	26.3	18.6	0.0	0.0	9.2	17.0	9.4
91-180	16.4	17.4	0.0	0.0	12.4	11.4	5.0
>180	32.3	30.8	8.5	11.5	2.9	1.5	19.4
Total	964.1	633.3	236.9	490.3	105.2	182.6	291.3

* 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	1.2 %	2.3 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.9 %	1.5 %	1.5 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
91-180	1.6 %	2.1 %	1.5 %	1.8 %
>180	2.3 %	2.5 %	2.0 %	2.2 %
Total	1.4 %	1.7 %	1.3 %	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

Sectores	16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	153	7630	6879	18	126	3783	4461	14	160	2373	2640
Intragrupa y off-shore***	0	0	2714	2797	0	0	1919	1237	0	0	1096	822
Otros	153	29	1720	2388	126	18	905	910	160	14	450	456
Total	181	181	12064	12064	144	144	6607	6607	174	174	3918	3918

* 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.