Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 19 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$1028.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	218.7	132.2	76.9	169.5	18.2	12.2	37.0
15-35	433.1	447.6	108.9	53.8	22.7	63.3	316.0
36-60	0.7	18.9	0.0	0.0	18.9	0.7	0.0
61-90	49.8	68.8	0.0	0.0	23.8	4.8	45.0
91-180	35.9	15.3	0.0	0.0	10.3	30.9	5.0
>180	7.1	2.7	0.0	0.0	2.7	7.1	0.0
Total	**745.3**	**685.6**	**185.8**	**223.3**	**96.8**	**119.0**	**403.0**

* 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	1.3 %	1.3 %	0.8 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.4 %	0.4 %	1.4 %
61-90	1.5 %	1.8 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.7 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
>180	-	2.5 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.3 %	1.4 %	1.3 %	1.3 %

*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**	28	181	8115	7110	22	122	4569	4737	15	96	2522	2841
Intragrupo y off-shore***	0	0	2844	3201	0	0	1937	1772	0	0	1131	862
Otros	181	28	1729	2377	122	22	1064	1061	96	15	524	473
Total	**209**	**209**	**12687**	**12687**	**144**	**144**	**7569**	**7569**	**111**	**111**	**4177**	**4177**

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.