Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 20 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$1045.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.[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	194.9	160.3	77.0	110.5	26.3	27.4	57.0
15-35	194.7	398.6	222.8	35.5	59.9	43.2	116.0
36-60	4.2	9.6	0.2	0.0	9.4	4.2	0.0
61-90	53.0	18.9	0.0	35.2	5.9	4.9	13.0
91-180	6.4	7.2	0.0	0.0	7.2	6.4	0.0
>180	180.0	138.4	0.0	15.0	3.4	30.0	135.0
Total	**633.2**	**733.1**	**299.9**	**196.2**	**112.2**	**116.1**	**321.0**

* 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 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.4 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.6 %	1.4 %	1.6 %
61-90	1.5 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	2.5 %	1.7 %	2.1 %
>180	2.0 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
Total	1.7 %	1.5 %	1.5 %	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**	28	183	8114	7116	24	124	4692	4767	16	97	2590	2965
Intragrupo y off-shore***	0	0	2844	3201	0	0	1957	1882	0	0	1188	863
Otros	183	28	1736	2377	124	24	1068	1069	97	16	539	489
Total	**211**	**211**	**12694**	**12694**	**148**	**148**	**7718**	**7718**	**113**	**113**	**4318**	**4318**

* 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.