

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1747.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	602.4	409.0	125.4	314.0	23.7	28.5	260.0
15-35	338.2	308.3	203.8	195.3	73.4	111.9	31.1
36-60	106.5	112.9	48.9	48.8	64.0	57.8	0.0
61-90	9.0	14.2	0.0	0.0	14.2	9.0	0.0
91-180	55.9	38.5	0.0	10.0	38.5	45.9	0.0
>180	21.5	21.7	20.0	20.0	1.7	1.5	0.0
Total	1133.6	904.8	398.1	588.0	215.6	254.6	291.1

* 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	
3-14	1.1 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
15-35	1.1 %	1.0 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.4 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
>180	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.1 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %

*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	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	174	6224	5692	25	148	6488	5957	18	128	3504	4123
Intragrupo y off-shore***	0	0	3101	2795	0	0	2172	2012	0	0	1748	1100
Otros	174	25	972	1810	148	25	1575	2266	128	18	847	876
Total	199	199	10297	10297	173	173	10235	10235	146	146	6099	6099

* 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) $^{\wedge}$ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.