

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 17 de septiembre de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1354.3 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	530.7	220.0	47.4	375.6	28.6	11.1	144.0
15-35	399.2	334.5	130.0	123.0	48.5	120.3	156.0
36-60	13.4	58.5	52.1	0.0	6.4	13.4	0.0
61-90	3.8	5.5	3.4	0.0	2.1	3.8	0.0
91-180	23.9	43.1	0.0	0.0	28.1	8.9	15.0
>180	34.8	31.8	0.0	0.0	1.8	4.8	30.0
Total	1005.8	693.4	233.0	498.6	115.5	162.3	345.0

* 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 %		1.4 %	1.0 %	1.2 %
15-35	1.2 %		1.3 %	1.2 %	1.2 %
36-60	-		1.6 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-		2.0 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.7 %		2.0 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.9 %		2.4 %	2.1 %	2.0 %
Total	1.3 %		1.4 %	1.2 %	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**	30	150	7911	6970	19	127	4011	4544	15	160	2443	2721
Intragrupo y off-shore***	0	0	2730	3010	0	0	1927	1399	0	0	1131	852
Otros	150	30	1724	2385	127	19	926	921	160	15	456	457
Total	180	180	12365	12365	146	146	6865	6865	175	175	4031	4031

* 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.