

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2019

Fecha de Información: 04 de octubre 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\$1196.6 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	358.7	282.2	85.3	161.5	17.0	17.2	180.0
15-35	369.3	334.7	142.0	191.8	28.7	13.6	164.0
36-60	6.2	100.3	0.0	0.0	100.3	6.2	0.0
61-90	9.5	30.0	0.0	4.3	30.0	5.2	0.0
91-180	21.6	26.7	0.0	0.0	16.7	11.6	10.0
>180	4.8	6.5	0.0	0.0	6.5	4.8	0.0
Total	770.1	780.5	227.3	357.6	199.3	58.6	354.0

* 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	2.1 %	0.8 %	1.0 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.9 %
91-180	1.7 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
>180	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %
Total	1.7 %	1.5 %	1.2 %	1.5 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	111	4033	4306	28	151	4978	4819	22	97	2373	2290
Intragruppo y off-shore***	0	0	1851	1543	0	0	2124	1875	0	0	946	783
Otros	111	35	676	711	151	28	1305	1713	97	22	488	735
Total	147	147	6560	6560	178	178	8408	8408	120	120	3807	3807

* 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.