

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2019

Fecha de Información: 10 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\$1222.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 359.3 | 292.2 | 59.0 | 110.0 | 136.2 | 152.3 | 97.0 |
| 15-35 | 292.2 | 350.9 | 147.9 | 78.6 | 27.8 | 38.3 | 175.3 |
| 36-60 | 77.4 | 26.0 | 0.0 | 0.0 | 26.0 | 77.4 | 0.0 |
| 61-90 | 21.2 | 23.8 | 0.0 | 0.0 | 22.8 | 20.2 | 1.0 |
| 91-180 | 2.5 | 11.7 | 0.0 | 0.0 | 10.2 | 1.0 | 1.5 |
| >180 | 15.2 | 24.5 | 10.0 | 10.0 | 14.5 | 5.2 | 0.0 |
| Total | 767.8 | 729.2 | 216.9 | 198.6 | 237.6 | 294.4 | 274.8 |

* 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 % | 1.3 % | 1.3 % |
| 15-35 | 1.4 % | 1.7 % | 1.4 % | 1.5 % |
| 36-60 | - | 1.6 % | 1.4 % | 1.4 % |
| 61-90 | 1.4 % | 1.7 % | 1.7 % | 1.7 % |
| 91-180 | 1.6 % | 2.1 % | 1.4 % | 2.0 % |
| >180 | - | 2.2 % | 1.9 % | 2.1 % |
| Total | 1.4 % | 1.6 % | 1.4 % | 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 | 7 al 11 de octubre | | | | 14 al 18 de octubre | | | | 21 al 25 de octubre | | | |
|-----------------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 33 | 141 | 5607 | 5611 | 24 | 97 | 2766 | 2781 | 11 | 118 | 2899 | 3042 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2657 | 2264 | 0 | 0 | 1077 | 891 | 0 | 0 | 1124 | 905 |
| Otros | 141 | 33 | 1329 | 1718 | 97 | 24 | 793 | 964 | 118 | 11 | 559 | 636 |
| Total | 174 | 174 | 9593 | 9593 | 121 | 121 | 4636 | 4636 | 128 | 128 | 4583 | 4583 |

* 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.