

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2019

Fecha de Información: 30 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\$1129.8 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	258.1	193.1	102.0	159.5	15.1	22.6	76.0
15-35	232.0	395.7	244.5	40.8	20.2	60.3	131.0
36-60	65.8	87.1	0.0	0.0	86.1	64.8	1.0
61-90	52.6	15.4	6.2	0.0	9.2	52.6	0.0
91-180	4.4	21.8	0.0	0.0	21.8	4.4	0.0
>180	10.5	3.1	0.0	3.9	1.2	4.7	1.9
Total	623.5	716.2	352.7	204.2	153.6	209.4	209.9

* 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	1.6 %	1.5 %	0.8 %	1.2 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.3 %	1.6 %
36-60	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.3 %	1.6 %	2.2 %
>180	2.0 %	3.4 %	2.1 %	2.2 %
Total	1.6 %	1.7 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	104	3515	3849	24	142	4166	3834	21	94	2072	2018
Intragrupa y off-shore***	0	0	1552	1230	0	0	1926	1575	0	0	876	683
Otros	104	35	720	707	142	24	814	1497	94	21	470	716
Total	139	139	5787	5787	166	166	6906	6906	115	115	3418	3418

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