

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2019

Fecha de Información: 01 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\$1113.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	162.4	92.9	53.2	98.5	19.2	43.4	20.5
15-35	213.1	388.0	285.5	65.0	13.0	58.6	89.5
36-60	156.8	86.2	0.0	0.0	84.2	154.8	2.0
61-90	35.1	41.1	24.7	0.0	16.4	35.1	0.0
91-180	8.6	1.9	0.0	4.2	1.9	4.4	0.0
>180	22.4	32.8	14.9	0.0	1.9	6.4	16.0
Total	598.3	642.9	378.2	167.7	136.7	302.6	128.0

* 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	1.4 %	1.8 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	1.7 %
>180	2.1 %	2.5 %	1.9 %	2.2 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %

*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	109	3591	3880	26	142	4248	3876	22	94	2089	2049
Intragrupa y off-shore***	0	0	1559	1287	0	0	1953	1615	0	0	898	690
Otros	109	35	723	706	142	26	829	1539	94	22	473	721
Total	144	144	5872	5872	168	168	7030	7030	116	116	3460	3460

* 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.