

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2019

Fecha de Información: 02 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\$1681.3 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	471.3	452.0	204.2	204.1	20.2	39.8	227.5
15-35	505.0	602.1	270.9	174.4	34.8	34.1	296.5
36-60	59.3	13.2	0.0	5.7	3.2	43.6	10.0
61-90	75.9	23.1	2.2	10.0	3.9	48.9	17.0
91-180	2.9	1.6	0.0	0.0	1.6	2.9	0.0
>180	5.1	20.9	20.0	0.2	0.9	4.8	0.0
Total	1119.5	1112.8	497.3	394.4	64.5	174.1	551.0

* 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	1.6 %	1.2 %	1.6 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.7 %	2.2 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.7 %	1.9 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.6 %	1.8 %
>180	-	2.4 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.6 %	1.6 %	1.6 %	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	113	3858	4142	26	144	4392	3975	22	95	2259	2140
Intragrupa y off-shore***	0	0	1753	1430	0	0	1963	1653	0	0	898	771
Otros	113	35	668	707	144	26	843	1572	95	22	478	725
Total	148	148	6279	6279	170	170	7199	7199	116	116	3635	3635

* 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.