

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2019

Fecha de Información: 07 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\$940.7 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	162.9	240.1	125.0	110.0	69.1	7.0	46.0
15-35	261.0	196.4	107.6	130.5	12.2	53.9	76.6
36-60	96.4	58.1	0.0	4.5	55.6	89.5	2.5
61-90	2.1	8.3	6.6	0.0	1.7	2.1	0.0
91-180	7.0	12.3	0.0	0.0	12.3	7.0	0.0
>180	20.9	20.2	0.0	0.0	0.2	0.9	20.0
Total	550.4	535.4	239.2	244.9	151.1	160.4	145.1

* 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	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.2 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-	2.0 %	1.5 %	1.8 %
>180	2.4 %	2.2 %	2.1 %	2.4 %
Total	1.6 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	30	149	5115	5091	22	96	2390	2373	10	115	2705	2868
Intragrupa y off-shore***	0	0	2348	1977	0	0	956	786	0	0	1105	859
Otros	149	30	1316	1712	96	22	551	738	115	10	476	560
Total	178	178	8780	8780	119	119	3897	3897	125	125	4287	4287

* 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.