

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2019

Fecha de Información: 15 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\$1718.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	274.2	174.8	89.0	189.0	17.6	17.0	68.2
15-35	611.0	693.0	278.2	108.4	127.3	215.1	287.5
36-60	81.5	37.7	0.0	0.0	25.2	69.0	12.5
61-90	39.2	36.7	0.0	0.0	36.7	39.2	0.0
91-180	22.8	32.6	0.0	0.0	17.6	7.8	15.0
>180	55.3	92.5	30.8	0.0	11.7	5.3	50.0
Total	1083.9	1067.3	398.0	297.4	236.1	353.3	433.2

* 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 %	1.5 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
36-60	1.3 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.4 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.9 %	2.1 %
Total	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.4 %

*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	14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	103	3265	3074	13	123	2946	3090	44	112	2633	3355
Intragruppo y off-shore***	0	0	1190	1225	0	0	1127	922	0	0	1487	719
Otros	103	24	831	986	123	13	579	640	112	44	619	665
Total	127	127	5285	5285	136	136	4652	4652	156	156	4739	4739

* 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.