

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2019

Fecha de Información: 16 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\$1603.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	383.4	288.9	114.0	193.0	27.9	43.4	147.0
15-35	367.7	415.3	307.3	158.4	27.0	128.3	81.0
36-60	120.8	93.7	0.0	0.0	93.7	120.8	0.0
61-90	57.9	83.4	3.7	30.0	59.7	7.9	20.0
91-180	19.2	13.1	0.1	15.0	13.0	4.2	0.0
>180	6.0	2.2	0.0	5.0	2.2	1.0	0.0
Total	955.1	896.5	425.0	401.4	223.5	305.7	248.0

* 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	0.8 %	1.1 %	1.3 %	1.1 %
15-35	0.8 %	1.1 %	1.0 %	1.0 %
36-60	-	1.1 %	1.1 %	1.1 %
61-90	1.1 %	1.5 %	1.1 %	1.3 %
91-180	-	1.7 %	1.2 %	1.4 %
>180	-	2.3 %	3.3 %	3.0 %
Total	0.8 %	1.2 %	1.1 %	1.1 %

*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**	23	105	3458	3157	14	117	3110	3260	44	112	2680	3402
Intragruppo y off-shore***	0	0	1219	1368	0	0	1196	969	0	0	1509	732
Otros	105	23	839	992	117	14	592	670	112	44	623	679
Total	128	128	5516	5516	131	131	4899	4899	156	156	4812	4812

* 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.