Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2019

Fecha de Información: 17 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$1616.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	306.9	270.1	104.5	81.8	120.6	180.2	45.0
15-35	533.2	500.8	235.8	267.5	50.2	50.9	214.8
36-60	79.3	27.9	16.5	0.0	11.5	79.3	0.0
61-90	8.4	21.2	0.0	0.0	19.7	6.9	1.5
91-180	16.2	32.8	11.9	10.0	20.9	6.2	0.0
>180	73.6	54.2	0.0	20.0	7.2	6.6	47.0
Total	**1017.6**	**907.1**	**368.7**	**379.3**	**230.1**	**330.1**	**308.3**

* 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	1.0 %	0.9 %	0.9 %	0.9 %
15-35	1.1 %	1.1 %	1.0 %	1.0 %
36-60	-	1.6 %	0.9 %	1.0 %
61-90	1.0 %	1.2 %	0.7 %	1.1 %
91-180	-	2.3 %	1.3 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
Total	1.2 %	1.1 %	1.0 %	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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/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	110	3499	3196	18	119	3286	3403	44	112	2770	3458
Intragrupo y off-shore***	0	0	1252	1393	0	0	1198	985	0	0	1579	772
Otros	110	23	835	996	119	18	709	805	112	44	600	719
Total	**133**	**133**	**5586**	**5586**	**137**	**137**	**5193**	**5193**	**156**	**156**	**4949**	**4949**

* 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.