

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2019

Fecha de Información: 25 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\$1370.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	374.6	370.7	154.5	151.0	42.2	49.6	174.0
15-35	417.7	338.8	169.5	218.8	20.3	49.9	149.0
36-60	6.9	14.0	4.8	0.0	9.2	6.9	0.0
61-90	10.9	27.3	0.0	0.0	27.3	10.9	0.0
91-180	21.4	35.9	0.0	0.0	25.9	11.4	10.0
>180	81.3	50.5	0.0	20.0	4.5	15.3	46.0
Total	912.7	837.2	328.8	389.8	129.4	143.9	379.0

* 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	0.9 %	2.1 %	0.6 %	1.2 %
15-35	0.9 %	0.8 %	0.5 %	0.7 %
36-60	-	1.6 %	0.6 %	1.2 %
61-90	-	1.4 %	1.1 %	1.3 %
91-180	1.3 %	2.2 %	1.7 %	1.9 %
>180	2.2 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
Total	1.0 %	1.5 %	0.7 %	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	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	129	4192	3880	53	131	3906	3994	24	95	2701	2597
Intragruppo y off-shore***	0	0	1415	1576	0	0	1732	1436	0	0	1136	1145
Otros	129	25	751	902	131	53	711	919	95	24	496	591
Total	154	154	6358	6358	184	184	6349	6349	119	119	4333	4333

* 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.