

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2019

Fecha de Información: 28 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\$1402.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.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	338.4	274.3	78.5	146.0	19.2	15.8	176.6
15-35	341.6	424.7	160.0	150.6	125.7	52.0	139.0
36-60	31.7	51.5	5.0	26.7	46.5	5.0	0.0
61-90	67.3	13.9	0.0	0.1	13.9	67.1	0.0
91-180	92.4	41.8	0.0	58.0	36.8	29.4	5.0
>180	43.0	32.3	0.0	0.0	2.3	13.0	30.0
Total	914.3	838.5	243.5	381.4	244.4	182.3	350.6

* 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 %	0.7 %	0.8 %	0.9 %
15-35	0.7 %	0.8 %	0.5 %	0.7 %
36-60	-	1.1 %	0.9 %	1.0 %
61-90	-	1.8 %	1.1 %	1.3 %
91-180	1.3 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
>180	2.3 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
Total	1.0 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %

*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	28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	137	4132	4156	24	97	2812	2704	15	103	2795	2662
Intragruppo y off-shore***	0	0	1794	1563	0	0	1153	1164	0	0	1097	799
Otros	137	53	724	930	97	24	497	594	103	15	738	1169
Total	190	190	6650	6650	121	121	4461	4461	118	118	4630	4630

* 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.