

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$2019.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	276.4	263.9	28.5	110.0	79.4	10.4	156.0
15-35	912.4	582.2	71.5	509.7	118.7	10.8	392.0
36-60	6.2	60.6	0.0	0.0	60.6	6.2	0.0
61-90	109.2	76.6	0.0	100.0	76.6	9.2	0.0
91-180	37.9	143.4	1.0	0.0	127.5	22.9	15.0
>180	72.6	55.9	9.0	26.0	31.9	31.6	15.0
Total	1414.8	1182.7	110.0	745.7	494.7	91.1	578.0

* 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	1.1 %	1.6 %	0.2 %	1.1 %
15-35	1.1 %	1.3 %	1.0 %	1.1 %
36-60	-	1.8 %	1.0 %	1.7 %
61-90	-	1.8 %	1.4 %	1.8 %
91-180	1.5 %	2.0 %	1.4 %	1.8 %
>180	1.9 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
Total	1.1 %	1.7 %	1.0 %	1.3 %

*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	136	4782	4348	42	113	3542	3294	24	120	3042	2923
Intragruppo y off-shore***	0	0	1888	2109	0	0	1313	1425	0	0	1113	909
Otros	136	53	750	962	113	42	683	818	120	24	903	1225
Total	189	189	7419	7419	155	155	5537	5537	145	145	5058	5058

* 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.