

Fecha de Publicación: 7 de octubre de 2019

Fecha de Información: 03 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\$2770.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	511.5	786.2	122.0	186.0	472.2	133.5	192.0
15-35	660.2	604.3	241.5	308.3	94.8	83.8	268.0
36-60	260.5	59.5	0.0	0.0	59.5	260.5	0.0
61-90	38.3	33.4	4.5	0.0	22.9	32.3	6.0
91-180	117.6	39.3	0.3	0.0	34.0	112.6	5.0
>180	78.3	112.7	50.0	12.3	2.7	6.0	60.0
Total	1666.3	1635.5	418.3	506.6	686.2	628.7	531.0

* 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	1.6 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	1.7 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %
91-180	1.8 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.1 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
Total	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	112	4032	4306	27	146	4631	4568	22	95	2358	2268
Intragrupa y off-shore***	0	0	1851	1543	0	0	2057	1721	0	0	928	776
Otros	112	35	676	710	146	27	1300	1701	95	22	484	727
Total	147	147	6559	6559	173	173	7989	7989	117	117	3770	3770

* 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.

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.