

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2019

Fecha de Información: 11 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\$965.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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 | 316.6 | 174.6 | 27.0 | 205.0 | 47.6 | 11.6 | 100.0 |
| 15-35 | 222.0 | 262.7 | 189.0 | 165.0 | 31.7 | 15.0 | 42.0 |
| 36-60 | 13.8 | 23.0 | 0.0 | 0.0 | 20.5 | 11.3 | 2.5 |
| 61-90 | 12.5 | 41.2 | 0.0 | 0.0 | 36.2 | 7.5 | 5.0 |
| 91-180 | 1.2 | 24.9 | 0.0 | 0.0 | 24.9 | 1.2 | 0.0 |
| >180 | 5.0 | 17.1 | 0.0 | 3.0 | 17.1 | 2.0 | 0.0 |
| Total | 571.1 | 543.6 | 216.0 | 373.0 | 178.1 | 48.6 | 149.5 |

* 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 | 1.3 % | 1.9 % | 1.2 % | 1.4 % |
| 15-35 | 1.3 % | 1.5 % | 1.3 % | 1.4 % |
| 36-60 | 1.4 % | 1.9 % | 1.4 % | 1.7 % |
| 61-90 | 1.4 % | 1.9 % | 1.4 % | 1.8 % |
| 91-180 | - | 2.1 % | 1.4 % | 2.0 % |
| >180 | - | 2.2 % | 2.9 % | 2.3 % |
| Total | 1.3 % | 1.7 % | 1.3 % | 1.5 % |

*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

| Sectores | 7 al 11 de octubre | | | | 14 al 18 de octubre | | | | 21 al 25 de octubre | | | |
|---------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 33 | 141 | 5609 | 5611 | 24 | 106 | 3051 | 2898 | 11 | 123 | 2936 | 3076 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2657 | 2264 | 0 | 0 | 1104 | 1079 | 0 | 0 | 1124 | 922 |
| Otros | 141 | 33 | 1330 | 1720 | 106 | 24 | 803 | 981 | 123 | 11 | 572 | 636 |
| Total | 173 | 173 | 9595 | 9595 | 129 | 129 | 4957 | 4957 | 134 | 134 | 4633 | 4633 |

* 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.