

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2019

Fecha de Información: 21 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\$1152.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	334.7	121.5	98.0	298.0	11.5	24.7	12.0
15-35	232.6	401.5	261.0	43.0	55.5	104.6	85.0
36-60	70.4	67.6	0.0	0.0	66.6	69.4	1.0
61-90	2.4	4.1	0.0	0.0	4.1	2.4	0.0
91-180	1.8	11.7	0.0	0.0	11.7	1.8	0.0
>180	0.7	1.1	0.0	0.0	1.1	0.7	0.0
Total	642.7	607.5	359.0	341.0	150.5	203.7	98.0

* 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 %	1.1 %	0.8 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.1 %	0.8 %	1.0 %
36-60	1.0 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.6 %	0.8 %	1.3 %
91-180	-	1.6 %	1.2 %	1.6 %
>180	-	1.5 %	1.6 %	1.5 %
Total	0.9 %	1.2 %	0.9 %	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**	26	129	3788	3643	46	113	3005	3522	18	85	2474	2370
Intragruppo y off-shore***	0	0	1325	1326	0	0	1598	945	0	0	1062	1092
Otros	129	26	745	889	113	46	619	755	85	18	463	537
Total	156	156	5858	5858	159	159	5221	5221	103	103	4000	4000

* 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.