

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2019

Fecha de Información: 23 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\$1439.1 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	335.9	176.1	56.5	201.5	43.7	58.6	75.9
15-35	359.0	362.0	122.5	155.5	123.4	87.4	116.1
36-60	89.2	146.1	0.0	0.0	146.1	89.2	0.0
61-90	15.7	39.8	0.0	10.0	34.8	0.7	5.0
91-180	16.1	41.5	0.1	0.0	41.4	16.1	0.0
>180	41.7	43.0	0.0	0.0	13.0	11.7	30.0
Total	857.6	808.4	179.1	367.0	402.4	263.7	227.0

* 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	0.7 %	0.6 %	0.6 %	0.6 %
15-35	0.7 %	0.9 %	0.6 %	0.7 %
36-60	-	1.1 %	1.0 %	1.1 %
61-90	1.0 %	1.4 %	0.9 %	1.2 %
91-180	-	1.7 %	1.1 %	1.5 %
>180	1.9 %	2.4 %	1.9 %	2.0 %
Total	0.8 %	1.1 %	0.7 %	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	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**	25	132	4122	3841	51	125	3327	3668	18	91	2596	2464
Intragruppo y off-shore***	0	0	1412	1544	0	0	1629	1147	0	0	1062	1096
Otros	132	25	745	894	125	51	634	775	91	18	481	579
Total	157	157	6279	6279	177	177	5590	5590	109	109	4139	4139

* 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.