

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2019

Fecha de Información: 29 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\$2336.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	511.3	258.4	108.1	336.0	66.3	91.3	84.0
15-35	480.7	553.2	378.1	293.9	53.5	65.2	121.6
36-60	30.3	148.2	126.5	4.4	11.7	15.9	10.0
61-90	2.7	14.7	0.0	0.0	14.7	2.7	0.0
91-180	213.2	120.3	10.0	121.0	55.3	37.2	55.0
>180	136.6	178.3	101.0	81.0	36.3	14.6	41.0
Total	1374.9	1273.1	723.7	836.3	237.8	227.0	311.6

* 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	0.8 %	1.1 %	0.8 %	0.8 %
15-35	0.9 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %
36-60	1.2 %	1.2 %	0.9 %	1.2 %
61-90	-	1.5 %	1.1 %	1.5 %
91-180	1.2 %	1.9 %	1.2 %	1.4 %
>180	2.2 %	2.3 %	1.9 %	2.2 %
Total	1.1 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %

*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**	55	136	4470	4263	33	101	3008	2851	22	107	2824	2710
Intragruppo y off-shore***	0	0	1840	1847	0	0	1215	1229	0	0	1109	804
Otros	136	55	740	940	101	33	547	691	107	22	769	1187
Total	191	191	7050	7050	133	133	4770	4770	128	128	4702	4702

* 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.