

Fecha de Publicación: 5 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 31 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\$1839.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	378.5	329.6	75.0	160.7	155.6	118.8	99.0
15-35	491.2	406.6	190.7	189.0	44.8	131.0	171.2
36-60	40.4	66.9	12.3	0.0	54.7	40.4	0.0
61-90	47.1	19.2	0.0	20.0	17.2	25.1	2.0
91-180	95.4	68.1	14.0	40.0	29.1	30.4	25.0
>180	57.8	135.3	124.3	57.0	11.1	0.8	0.0
Total	1110.4	1025.8	416.2	466.7	312.4	346.5	297.2

* 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	1.1 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.4 %	1.0 %	1.2 %
36-60	-	1.6 %	1.3 %	1.5 %
61-90	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.8 %	1.1 %	1.5 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.2 %
Total	1.2 %	1.4 %	1.1 %	1.2 %

*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**	53	136	4782	4348	37	103	3376	3143	24	111	2931	2832
Intragruppo y off-shore***	0	0	1888	2109	0	0	1289	1389	0	0	1109	835
Otros	136	53	750	962	103	37	671	804	111	24	856	1228
Total	190	190	7419	7419	140	140	5336	5336	135	135	4896	4896

* 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.