

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2019

Fecha de Información: 26 de septiembre 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\$1595.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	323.5	323.4	93.2	79.0	162.0	176.3	68.2
15-35	426.4	535.9	194.1	100.0	76.0	60.6	265.9
36-60	63.8	63.1	0.0	0.0	63.1	63.8	0.0
61-90	30.7	25.9	0.0	0.0	2.9	7.7	23.0
91-180	50.2	76.7	10.0	0.0	16.7	0.2	50.0
>180	59.4	65.4	20.0	0.0	3.4	17.4	42.0
Total	954.0	1090.4	317.4	179.0	324.0	326.0	449.0

* 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	1.5 %	1.6 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	1.7 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.8 %	2.1 %	1.0 %	1.9 %
>180	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
Total	1.7 %	1.6 %	1.6 %	1.6 %

*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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	151	5315	5157	26	95	3137	3535	19	140	4107	3690
Intragruppo y off-shore***	0	0	2189	2315	0	0	1385	979	0	0	1853	1607
Otros	151	18	1093	1125	95	26	684	692	140	19	810	1473
Total	170	170	8597	8597	120	120	5206	5206	159	159	6770	6770

* 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.