

Fecha de Publicación: 1 de octubre de 2019

Fecha de Información: 27 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\$966.6 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	229.6	275.6	138.0	93.4	34.1	32.7	103.5
15-35	110.0	288.8	160.4	36.5	99.8	44.9	28.6
36-60	25.9	11.7	0.0	1.3	11.7	24.6	0.0
61-90	46.8	40.5	0.0	0.0	30.5	36.8	10.0
91-180	17.5	14.0	0.0	0.0	4.0	7.5	10.0
>180	49.8	23.6	0.0	30.9	8.6	3.9	15.0
Total	479.5	654.2	298.4	162.1	188.7	150.3	167.1

* 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	
3-14	1.6 %	2.1 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.7 %	0.8 %	1.5 %
36-60	-	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.8 %	1.4 %	1.6 %	1.5 %
91-180	1.8 %	2.3 %	1.6 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.3 %	2.2 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.3 %	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	5349	5157	34	99	3274	3720	22	140	4152	3774
Intragrupo y off-shore***	0	0	2189	2349	0	0	1507	1073	0	0	1869	1573
Otros	151	18	1093	1125	99	34	711	700	140	22	812	1485
Total	169	169	8631	8631	133	133	5493	5493	162	162	6832	6832

* 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.