

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2019

Fecha de Información: 09 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\$1345.5 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	298.1	236.2	126.3	187.6	5.9	6.5	104.0
15-35	340.7	308.1	144.8	145.4	52.3	84.2	111.0
36-60	106.5	77.6	0.0	0.0	77.6	106.5	0.0
61-90	2.3	19.4	0.0	0.0	17.4	0.3	2.0
91-180	34.0	12.6	0.0	0.0	12.6	34.0	0.0
>180	85.2	93.9	40.0	30.8	1.9	2.4	52.0
Total	866.8	747.7	311.1	363.8	167.7	234.0	269.0

* 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	1.6 %		1.4 %	1.5 %	1.5 %
15-35	1.5 %		1.7 %	1.3 %	1.5 %
36-60	-		1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.6 %		1.9 %	0.7 %	1.9 %
91-180	-		2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %		2.5 %	2.4 %	2.3 %
Total	1.7 %		1.7 %	1.5 %	1.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3												
Vencimientos de Forwards												
Sectores	7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	152	5521	5477	24	97	2571	2584	9	117	2819	2999
Intragrupo y off-shore***	0	0	2561	2209	0	0	1039	873	0	0	1124	868
Otros	152	33	1321	1717	97	24	664	817	117	9	553	630
Total	185	185	9403	9403	121	121	4274	4274	125	125	4497	4497

* 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.

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.