

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2019

Fecha de Información: 18 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\$1285.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	400.8	190.0	48.0	216.0	51.0	93.8	91.0
15-35	236.7	284.7	171.5	155.5	43.2	11.2	70.0
36-60	72.6	105.2	13.0	0.0	91.5	71.9	0.7
61-90	9.1	18.4	0.0	0.0	13.4	4.1	5.0
91-180	50.1	42.4	0.0	12.1	33.1	28.7	9.3
>180	20.9	50.3	20.0	0.0	10.3	0.9	20.0
Total	790.2	690.8	252.5	383.6	242.3	210.7	196.0

* 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	3.4 %	1.0 %	-0.1 %	0.8 %
15-35	1.2 %	0.9 %	0.8 %	0.9 %
36-60	0.7 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
61-90	1.1 %	1.4 %	1.0 %	1.2 %
91-180	1.2 %	1.7 %	1.1 %	1.4 %
>180	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
Total	2.3 %	1.1 %	0.4 %	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	14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	110	3499	3196	24	127	3578	3540	44	113	2884	3504
Intragrupo y off-shore***	0	0	1252	1393	0	0	1230	1126	0	0	1595	847
Otros	110	23	835	996	127	24	743	885	113	44	610	738
Total	133	133	5586	5586	151	151	5551	5551	158	158	5088	5088

* 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.