

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2019

Fecha de Información: 22 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\$1372.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	432.8	271.9	61.0	223.8	12.9	11.0	198.0
15-35	407.6	330.0	120.5	196.8	109.5	110.9	100.0
36-60	65.5	35.8	0.4	0.0	35.4	65.5	0.0
61-90	6.3	5.8	0.0	0.0	5.8	6.3	0.0
91-180	5.7	32.5	15.0	0.0	17.5	5.7	0.0
>180	24.0	53.0	50.0	20.5	3.0	3.5	0.0
Total	941.8	729.1	246.9	441.1	184.2	202.8	298.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.9 %	1.1 %	0.8 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.1 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	1.4 %	0.9 %	1.1 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.7 %
>180	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
Total	0.9 %	1.2 %	0.9 %	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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	129	4006	3720	50	113	3149	3649	18	86	2555	2449
Intragruppo y off-shore***	0	0	1355	1497	0	0	1629	993	0	0	1062	1096
Otros	129	24	747	891	113	50	625	761	86	18	467	538
Total	153	153	6109	6109	163	163	5403	5403	104	104	4083	4083

* 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.