

Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2019

Fecha de Información: 24 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\$1846.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.9%.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	367.7	206.3	25.8	210.7	142.5	118.9	38.0
15-35	532.0	471.5	167.8	217.5	61.3	72.1	242.4
36-60	151.4	63.3	33.0	27.3	29.4	123.2	0.9
61-90	18.7	53.4	0.0	0.0	35.4	0.7	18.0
91-180	33.1	72.0	0.0	0.0	62.0	23.1	10.0
>180	142.4	103.4	40.0	20.0	3.4	62.4	60.0
Total	1245.3	970.0	266.5	475.5	334.1	400.5	369.3

* 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	0.6 %	1.0 %	0.4 %	0.6 %
15-35	0.7 %	0.8 %	0.6 %	0.7 %
36-60	0.6 %	1.3 %	0.9 %	1.0 %
61-90	1.0 %	1.4 %	0.6 %	1.2 %
91-180	1.2 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
Total	0.9 %	1.1 %	0.7 %	0.9 %

*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	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**	26	132	4192	3881	51	125	3594	3815	18	95	2647	2492
Intragruppo y off-shore***	0	0	1415	1576	0	0	1638	1294	0	0	1075	1136
Otros	132	26	752	902	125	51	763	886	95	18	488	582
Total	157	157	6359	6359	176	176	5995	5995	113	113	4210	4210

* 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.