

Fecha de Publicación: 1 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 30 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\$1492.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	356.3	129.5	47.0	292.3	54.5	36.0	28.0
15-35	350.0	549.8	318.5	156.8	122.3	84.2	109.0
36-60	58.1	17.6	3.6	50.0	13.0	7.1	1.0
61-90	36.7	21.8	0.0	0.0	21.8	36.7	0.0
91-180	30.3	31.0	0.0	0.0	31.0	30.3	0.0
>180	39.0	38.3	0.0	0.0	10.3	11.0	28.0
Total	870.3	788.0	369.1	499.0	252.9	205.3	166.0

* 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	1.2 %	1.3 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.3 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
36-60	1.1 %	1.5 %	0.5 %	1.1 %
61-90	-	1.5 %	1.4 %	1.4 %
91-180	-	2.2 %	1.3 %	1.8 %
>180	2.4 %	2.1 %	2.0 %	2.3 %
Total	1.5 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %

*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	28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	139	4733	4294	34	101	3065	2904	23	107	2880	2771
Intragruppo y off-shore***	0	0	1848	2077	0	0	1254	1271	0	0	1109	825
Otros	139	54	745	956	101	34	551	696	107	23	830	1223
Total	192	192	7326	7326	136	136	4870	4870	130	130	4819	4819

* 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.