

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 27 de noviembre 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\$2104.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	198.2	198.8	160.0	151.9	24.8	32.3	14.0
15-35	413.0	818.0	656.1	220.0	30.3	61.4	131.6
36-60	26.4	35.5	25.4	0.0	10.1	26.4	0.0
61-90	132.3	23.6	0.0	10.3	3.6	102.0	20.0
91-180	93.7	140.3	75.6	14.0	34.7	49.7	30.0
>180	139.3	130.6	76.6	20.0	4.0	69.3	50.0
Total	1002.9	1346.9	993.7	416.2	107.5	341.1	245.6

* 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	2.3 %	2.5 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.2 %
36-60	-	2.1 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.9 %	2.4 %	1.8 %	1.8 %
91-180	2.0 %	2.0 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.4 %	2.2 %	2.2 %	2.3 %
Total	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %

*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	25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	209	5983	5380	33	108	3358	3675	24	135	3750	4425
Intragruppo y off-shore***	0	0	1988	2765	0	0	1675	1508	0	0	2442	1347
Otros	209	45	1362	1188	108	33	1167	1016	135	24	900	1312
Total	254	254	9333	9333	141	141	6199	6199	159	159	7092	7084

* 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.