

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 12 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\$2752.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	436.9	544.9	439.1	304.2	49.8	76.7	56.0
15-35	691.2	839.3	482.1	257.9	215.2	291.4	142.0
36-60	58.8	6.6	0.0	0.0	5.6	57.8	1.0
61-90	44.1	125.6	110.1	0.0	15.5	44.1	0.0
91-180	21.8	32.3	5.3	0.0	27.0	21.8	0.0
>180	72.1	77.5	68.0	61.0	9.5	11.1	0.0
Total	1324.9	1626.2	1104.6	623.1	322.5	502.8	199.0

* 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	1.3 %	1.7 %	1.1 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	1.4 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
>180	-	2.3 %	1.8 %	2.2 %
Total	1.4 %	1.6 %	1.3 %	1.4 %

*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	11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	197	4116	4248	33	174	2926	3213	23	177	3824	3702
Intragruppo y off-shore***	0	0	1470	1648	0	0	1393	1123	0	0	1348	1227
Otros	197	45	1632	1322	174	33	1100	1083	177	23	802	1045
Total	242	242	7217	7217	207	207	5419	5419	200	200	5974	5974

* 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.