Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 15 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$2078.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.[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	440.1	447.2	190.5	177.5	18.7	24.6	238.0
15-35	577.9	455.5	181.1	304.6	52.4	51.3	222.0
36-60	50.5	85.7	77.6	37.0	8.1	13.5	0.0
61-90	2.3	35.9	28.0	0.0	6.9	1.3	1.0
91-180	156.6	47.9	10.0	60.0	7.9	66.6	30.0
>180	148.4	177.4	120.0	89.0	1.4	3.4	56.0
Total	**1375.8**	**1249.6**	**607.2**	**668.1**	**95.4**	**160.7**	**547.0**

* 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	1.8 %	1.4 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.1 %	1.4 %	1.7 %
61-90	1.6 %	1.9 %	1.0 %	1.7 %
91-180	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.3 %	2.1 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.5 %	1.7 %

*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 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**	42	154	4416	4339	45	231	3469	3727	26	178	4078	4112
Intragrupo y off-shore***	0	0	1577	1891	0	0	1633	1378	0	0	1437	1255
Otros	154	42	1616	1379	231	45	1084	1081	178	26	954	1102
Total	**196**	**196**	**7609**	**7609**	**275**	**275**	**6186**	**6186**	**204**	**204**	**6469**	**6469**

* 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.