Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 25 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$2275.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%[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	524.0	278.1	161.5	406.7	29.6	30.3	87.0
15-35	375.3	710.9	516.5	198.0	72.8	55.8	121.6
36-60	165.6	117.4	0.0	0.0	92.4	140.6	25.0
61-90	6.8	9.6	0.0	0.0	9.6	6.8	0.0
91-180	139.3	145.6	40.0	80.0	60.6	14.3	45.0
>180	72.5	68.6	6.3	2.5	2.3	10.0	60.0
Total	**1283.6**	**1330.2**	**724.3**	**687.1**	**267.4**	**257.8**	**338.6**

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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**	44	196	5355	5321	26	105	3299	3447	21	134	3646	3925
Intragrupo y off-shore***	0	0	1912	2203	0	0	1545	1486	0	0	2000	1347
Otros	196	44	1421	1164	105	26	1083	993	134	21	863	1229
Total	**241**	**241**	**8688**	**8688**	**131**	**131**	**5927**	**5927**	**155**	**155**	**6509**	**6501**

* 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.

[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.