

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 13 de noviembre de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2980.1 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	236.8	199.0	128.0	148.1	56.8	74.5	14.2
15-35	706.6	779.5	461.3	306.8	114.3	195.8	204.0
36-60	22.2	139.8	120.0	15.0	19.8	7.2	0.0
61-90	318.9	63.3	3.1	185.0	39.8	113.6	20.3
91-180	209.4	314.4	225.0	94.0	12.5	38.5	76.9
>180	165.6	160.1	119.0	123.0	21.1	22.6	20.0
Total	1659.3	1656.1	1056.4	871.9	264.3	452.1	335.4

* 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	
3-14	1.7 %	1.6 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
61-90	1.6 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
>180	2.0 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
Total	1.7 %	1.8 %	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**	44	199	4267	4337	36	177	2964	3273	25	177	3882	3753
Intragrupo y off-shore***	0	0	1545	1777	0	0	1428	1140	0	0	1371	1239
Otros	199	44	1646	1344	177	36	1114	1092	177	25	827	1088
Total	242	242	7458	7458	213	213	5505	5505	202	202	6080	6080

* 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.