

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 14 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\$2715.9 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	420.9	344.4	96.5	190.0	40.9	23.9	207.0
15-35	871.8	796.7	422.0	408.0	70.2	159.3	304.5
36-60	25.7	36.3	0.0	0.0	36.3	25.7	0.0
61-90	267.9	154.8	50.0	140.0	14.8	37.9	90.0
91-180	68.3	130.0	100.0	41.0	30.0	27.3	0.0
>180	76.5	149.3	123.5	43.0	0.8	8.5	25.0
Total	1730.9	1611.5	792.0	822.0	193.0	282.5	626.5

* 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	1.9 %	1.4 %	0.8 %	1.5 %
15-35	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.7 %	1.4 %	1.6 %
61-90	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
>180	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
Total	1.9 %	1.7 %	1.6 %	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: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	42	160	4416	4337	39	222	3139	3418	25	177	3978	3982
Intragruppo y off-shore***	0	0	1577	1891	0	0	1482	1216	0	0	1397	1239
Otros	160	42	1614	1379	222	39	1080	1068	177	25	947	1100
Total	202	202	7607	7607	261	261	5702	5702	201	201	6322	6322

* 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.