

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 18 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\$1264.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	164.9	136.2	98.5	104.0	17.4	40.6	20.3
15-35	277.3	423.3	267.9	115.2	114.4	121.2	41.0
36-60	125.0	116.0	4.6	0.0	49.4	63.0	62.0
61-90	7.7	8.8	0.0	0.0	8.8	7.7	0.0
91-180	7.8	16.2	6.0	0.0	10.2	7.8	0.0
>180	74.2	30.7	30.0	40.5	0.7	33.8	0.0
Total	656.9	731.1	406.9	259.6	200.9	274.0	123.3

* 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	1.7 %	1.6 %	1.8 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.8 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.3 %
Total	1.7 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %

*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	18 al 22 de noviembre				25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	233	3587	3830	29	179	4107	4141	18	107	3021	2948
Intragruppo y off-shore***	0	0	1706	1477	0	0	1462	1260	0	0	1253	1451
Otros	233	46	1095	1081	179	29	957	1124	107	18	937	813
Total	278	278	6388	6388	208	208	6525	6525	125	125	5212	5212

* 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.