

Fecha de Publicación: 25 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 21 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\$1646.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	381.5	344.3	150.7	196.0	98.6	90.5	95.0
15-35	285.3	453.9	382.4	194.4	25.5	44.9	46.0
36-60	38.2	25.9	0.0	0.0	25.9	38.2	0.0
61-90	6.2	6.0	0.0	0.0	6.0	6.2	0.0
91-180	101.5	95.5	50.0	70.0	15.5	1.5	30.0
>180	52.5	26.6	20.0	50.0	6.6	2.5	0.0
Total	865.2	952.4	603.1	510.4	178.3	183.8	171.0

* 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	2.5 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.2 %	1.6 %	1.9 %
91-180	2.1 %	2.2 %	1.4 %	2.1 %
>180	-	2.3 %	2.3 %	2.3 %
Total	2.4 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %

*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	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**	43	234	4268	4149	41	190	4550	4535	18	105	3260	3414
Intragrupo y off-shore***	0	0	1878	2005	0	0	1683	1548	0	0	1534	1468
Otros	234	43	1129	1120	190	41	996	1146	105	18	1075	987
Total	276	276	7274	7274	231	231	7229	7229	123	123	5869	5869

* 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.