

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 22 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\$2162.7 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 | 353.8 | 569.7 | 93.1 | 281.6 | 416.7 | 12.3 | 59.9 |
| 15-35 | 326.6 | 383.8 | 319.0 | 263.5 | 24.8 | 23.1 | 40.0 |
| 36-60 | 29.7 | 13.9 | 0.0 | 0.0 | 13.9 | 29.7 | 0.0 |
| 61-90 | 9.2 | 26.7 | 0.0 | 0.0 | 22.2 | 4.7 | 4.5 |
| 91-180 | 456.6 | 55.5 | 0.0 | 10.0 | 29.9 | 421.0 | 25.6 |
| >180 | 22.9 | 56.3 | 40.0 | 0.0 | 4.3 | 10.9 | 12.0 |
| Total | 1198.8 | 1106.0 | 452.1 | 555.1 | 511.9 | 501.7 | 142.0 |

* 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 | 2.3 % | | 2.3 % | 2.0 % | 2.2 % |
| 15-35 | 2.2 % | | 2.3 % | 2.1 % | 2.2 % |
| 36-60 | - | | 2.4 % | 2.0 % | 2.2 % |
| 61-90 | 2.0 % | | 2.6 % | 1.8 % | 2.4 % |
| 91-180 | 2.0 % | | 2.3 % | 2.0 % | 2.0 % |
| >180 | 2.3 % | | 2.3 % | 2.4 % | 2.3 % |
| Total | 2.2 % | | 2.3 % | 2.0 % | 2.2 % |

*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 | 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** | 41 | 232 | 4269 | 4151 | 45 | 192 | 4896 | 5088 | 20 | 105 | 3265 | 3428 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1878 | 2005 | 0 | 0 | 1765 | 1828 | 0 | 0 | 1545 | 1470 |
| Otros | 232 | 41 | 1131 | 1121 | 192 | 45 | 1407 | 1152 | 105 | 20 | 1079 | 990 |
| Total | 273 | 273 | 7277 | 7277 | 237 | 237 | 8068 | 8068 | 125 | 125 | 5889 | 5889 |

* 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.