

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 22 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\$2162.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo 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 intragruppo		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
Intragruppo 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\Delta} - 1) \times \text{Plazo}$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.