

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 26 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\$3276.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	536.2	260.2	203.7	432.2	14.5	62.0	42.0
15-35	660.9	917.8	655.0	446.4	101.5	53.2	161.4
36-60	180.7	80.2	0.0	0.0	80.2	180.7	0.0
61-90	132.6	43.7	1.2	13.1	40.5	117.5	2.0
91-180	81.3	256.5	200.0	10.0	51.5	66.3	5.0
>180	231.0	177.9	105.0	86.8	0.9	72.2	72.0
Total	1822.7	1736.3	1164.9	988.5	289.0	551.8	282.4

* 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	2.1 %	1.5 %	2.0 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
61-90	1.8 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
>180	2.4 %	2.2 %	2.2 %	2.3 %
Total	2.2 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %

*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	25 al 29 de noviembre				2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	207	5831	5448	29	106	3320	3542	23	133	3730	4209
Intragrupo y off-shore***	0	0	1978	2624	0	0	1640	1497	0	0	2253	1347
Otros	207	47	1440	1177	106	29	1083	1003	133	23	873	1292
Total	254	254	9249	9249	134	134	6042	6042	156	156	6857	6849

* 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.