

Fecha de Publicación: 2 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 28 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\$829.7 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	261.7	182.7	29.3	108.0	30.9	31.2	122.5
15-35	289.5	382.5	146.8	60.3	10.3	3.7	225.5
36-60	13.5	19.6	13.0	0.0	6.6	13.5	0.0
61-90	2.9	5.0	0.0	0.0	5.0	2.9	0.0
91-180	9.4	1.3	0.0	0.0	1.3	9.4	0.0
>180	9.1	0.5	0.0	0.0	0.5	9.1	0.0
Total	586.2	591.5	189.0	168.3	54.5	69.8	348.0

* 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	2.0 %	2.4 %	2.1 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.3 %	1.8 %	2.0 %
61-90	-	2.1 %	1.1 %	1.7 %
91-180	-	2.7 %	1.8 %	1.9 %
>180	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
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.

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: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	44	211	6017	5381	34	109	3513	3761	24	135	3875	4570
Intragrupo y off-shore***	0	0	1988	2803	0	0	1677	1578	0	0	2469	1347
Otros	211	44	1364	1184	109	34	1195	1046	135	24	902	1319
Total	255	255	9368	9368	143	143	6385	6385	159	159	7245	7237

* 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.