

Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 06 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\$2604.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	284.2	442.1	333.0	168.5	79.1	85.7	30.0
15-35	632.7	762.1	467.3	387.7	189.8	140.1	105.0
36-60	43.8	145.8	120.0	20.0	23.8	21.8	2.0
61-90	58.3	34.4	5.0	0.0	29.4	58.3	0.0
91-180	169.4	59.8	30.0	165.0	29.8	4.4	0.0
>180	82.2	66.1	10.0	30.0	16.1	12.2	40.0
Total	1270.7	1510.3	965.3	771.2	368.1	322.6	177.0

* 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	1.1 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.1 %	1.2 %	1.1 %	1.1 %
36-60	1.3 %	1.6 %	1.0 %	1.2 %
61-90	-	1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	2.0 %	1.5 %	1.6 %
>180	2.0 %	2.3 %	1.9 %	2.0 %
Total	1.3 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %

*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	4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre				18 al 22 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	111	3946	3757	30	141	3220	3151	28	175	2704	2783
Intragrupa y off-shore***	0	0	1650	1698	0	0	1226	968	0	0	1139	1073
Otros	111	41	693	834	141	30	941	1268	175	28	1037	1025
Total	152	152	6289	6289	171	171	5387	5387	203	203	4881	4881

* 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.