

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2019

Fecha de Información: 08 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\$3134.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	487.1	951.3	67.0	295.1	720.3	27.9	164.0
15-35	279.7	560.1	368.0	100.5	66.1	53.2	126.0
36-60	78.7	72.7	63.0	63.0	9.7	15.7	0.0
61-90	541.5	34.3	0.0	0.0	4.3	511.5	30.0
91-180	201.1	37.9	0.0	0.0	37.9	201.1	0.0
>180	140.6	154.9	54.0	49.0	15.9	6.6	85.0
Total	1728.7	1811.2	552.0	507.6	854.2	816.0	405.0

* 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	1.4 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	1.7 %	1.1 %	1.3 %
61-90	1.4 %	1.8 %	1.4 %	1.4 %
91-180	-	2.1 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.4 %	2.3 %	2.4 %	2.4 %
Total	1.6 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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**	38	104	4119	3866	41	145	3799	4110	30	174	2843	2988
Intragruppo y off-shore***	0	0	1723	1835	0	0	1336	1379	0	0	1191	1101
Otros	104	38	698	839	145	41	1662	1309	174	30	1092	1038
Total	142	142	6540	6540	186	186	6797	6797	204	204	5126	5126

* 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.