

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 02 de diciembre 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\$2656.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.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	269.1	517.5	338.0	104.0	32.5	18.1	147.0
15-35	850.8	502.3	217.2	562.7	8.2	11.1	277.0
36-60	224.0	216.1	25.0	38.7	95.1	89.3	96.0
61-90	166.1	164.4	0.0	0.0	164.4	166.1	0.0
91-180	45.1	47.3	16.2	20.6	11.1	4.5	20.0
>180	85.4	168.4	106.0	0.0	2.4	25.4	60.0
Total	1640.6	1616.1	702.3	726.0	313.8	314.5	600.0

* 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	2.3 %	2.3 %	1.4 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	2.1 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
91-180	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.4 %	2.3 %	2.5 %	2.4 %
Total	2.3 %	2.2 %	2.1 %	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	2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	75	117	3878	4244	26	135	4054	4862	84	206	4297	4583
Intragrupa y off-shore***	0	0	1999	1811	0	0	2596	1354	0	0	2681	2291
Otros	117	75	1236	1058	135	26	935	1361	206	84	769	873
Total	192	192	7113	7113	161	161	7585	7577	290	290	7748	7748

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