

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 12 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\$2447.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	638.5	282.8	95.0	469.3	50.2	31.6	137.6
15-35	723.0	709.2	333.0	325.7	98.2	119.3	278.0
36-60	57.0	113.2	58.0	1.2	24.5	25.2	30.7
61-90	170.8	118.1	2.1	0.0	21.0	75.8	95.0
91-180	33.1	103.1	50.0	20.1	53.1	13.0	0.0
>180	15.7	24.0	0.0	10.3	24.0	5.4	0.0
Total	1638.1	1350.4	538.1	826.5	271.0	270.3	541.3

* 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 %	1.6 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	1.9 %	2.2 %	1.9 %	1.9 %
91-180	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
>180	-	2.6 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %

*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	9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	142	6199	6328	91	221	5628	6193	14	132	3160	3982
Intragruppo y off-shore***	0	0	3247	2890	0	0	3483	3107	0	0	2524	1709
Otros	142	32	1291	1509	221	91	1289	1100	132	14	346	335
Total	174	174	10736	10728	312	312	10400	10400	146	146	6030	6025

* 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.