

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 13 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\$1790.7 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	439.9	298.2	180.0	356.0	57.2	22.9	61.0
15-35	340.1	514.5	378.2	179.3	80.9	105.4	55.4
36-60	102.8	87.1	14.0	0.0	73.1	102.8	0.0
61-90	23.2	29.5	2.0	0.0	17.5	13.2	10.0
91-180	13.5	54.8	22.0	0.0	27.8	8.5	5.0
>180	7.2	16.5	0.0	0.0	11.5	2.2	5.0
Total	926.7	1000.5	596.2	535.3	267.9	255.0	136.4

* 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 %	1.7 %	1.8 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.9 %	2.2 %	2.0 %	2.2 %
>180	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
Total	2.0 %	1.9 %	1.8 %	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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/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	6200	6329	91	201	5955	6495	15	133	3268	3992
Intragrupo y off-shore***	0	0	3247	2890	0	0	3663	3368	0	0	2524	1804
Otros	142	32	1291	1511	201	91	1360	1115	133	15	346	338
Total	174	174	10738	10730	292	292	10978	10978	148	148	6139	6134

* 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.