

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 17 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\$2029.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	467.7	348.0	96.0	256.5	157.0	116.2	95.0
15-35	516.3	572.8	350.0	322.3	33.3	4.5	189.5
36-60	48.7	73.8	0.0	3.0	47.8	19.7	26.0
61-90	6.2	18.2	0.0	5.0	18.2	1.2	0.0
91-180	125.3	31.3	0.0	100.0	16.3	10.3	15.0
>180	60.7	116.1	50.0	20.0	36.1	10.7	30.0
Total	1224.7	1160.2	496.0	706.8	308.7	162.4	355.5

* 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	1.7 %	2.0 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
36-60	1.7 %	2.1 %	1.5 %	1.8 %
61-90	-	2.2 %	1.6 %	2.2 %
91-180	1.8 %	2.4 %	1.8 %	1.8 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.4 %	1.7 %

*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	16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	91	210	6344	6835	18	138	3633	4213	5	42	2053	2342
Intragrupo y off-shore***	0	0	3877	3688	0	0	2526	1952	0	0	1678	1430
Otros	210	91	1444	1141	138	18	458	448	42	5	136	95
Total	302	302	11664	11664	156	156	6617	6612	47	47	3867	3867

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