

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 19 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\$2118.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	297.7	146.5	64.9	234.0	30.7	12.7	51.0
15-35	749.1	908.8	523.2	411.9	86.0	37.7	299.5
36-60	1.7	56.1	23.0	0.0	33.1	1.7	0.0
61-90	32.3	44.8	14.2	30.0	30.6	2.3	0.0
91-180	2.8	51.2	0.0	0.0	48.7	0.3	2.5
>180	150.8	97.2	7.0	70.0	23.2	13.8	67.0
Total	1234.3	1304.6	632.3	745.9	252.3	68.4	420.0

* 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 intragruo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %		1.8 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.6 %		1.6 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-		1.8 %	1.4 %	1.8 %
61-90	-		2.1 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.7 %		2.2 %	1.7 %	2.2 %
>180	2.5 %		2.5 %	2.4 %	2.5 %
Total	1.7 %		1.8 %	1.6 %	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**	94	213	6733	7057	17	155	3948	4301	4	49	2189	2385
Intragruo y off-shore***	0	0	3969	3957	0	0	2567	2236	0	0	1709	1550
Otros	213	94	1455	1143	155	17	491	465	49	4	141	97
Total	307	307	12157	12157	172	172	7006	7001	53	53	4038	4032

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.