

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 23 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\$2116.3 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	455.4	242.5	100.2	312.1	9.4	10.3	133.0
15-35	384.2	488.3	340.5	267.8	40.7	9.4	107.1
36-60	61.5	21.7	0.0	0.0	21.7	61.5	0.0
61-90	52.8	75.3	29.8	30.0	30.5	7.8	15.0
91-180	150.6	58.8	0.0	70.0	48.8	70.6	10.0
>180	129.8	338.4	15.0	50.0	245.4	1.8	78.0
Total	1234.3	1225.0	485.4	729.8	396.5	161.4	343.1

* 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	2.2 %	1.3 %	2.1 %	2.0 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.3 %	1.4 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.7 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
91-180	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.0 %
>180	2.4 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	159	4344	4489	5	48	2386	2558	20	89	3785	3508
Intragrupo y off-shore***	0	0	2668	2573	0	0	1773	1640	0	0	2102	2429
Otros	159	20	517	463	48	5	145	100	89	20	393	343
Total	179	179	7529	7524	53	53	4304	4298	110	110	6280	6280

* 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 intragrupo.