

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 24 de diciembre de 2019¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$726.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	75.0	83.4	43.0	39.5	5.4	0.5	35.0
15-35	270.8	211.5	145.0	219.5	16.5	1.3	50.0
36-60	4.5	14.1	0.0	0.0	14.1	4.5	0.0
61-90	70.3	28.9	10.5	70.0	18.4	0.3	0.0
91-180	1.3	21.3	0.0	0.0	21.3	1.3	0.0
>180	3.8	26.5	0.0	0.0	26.5	3.8	0.0
Total	425.7	385.6	198.5	329.0	102.1	11.7	85.0

* 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	
3-14	1.3 %	1.0 %	1.5 %	1.3 %
15-35	1.5 %	1.5 %	1.4 %	1.4 %
36-60	-	1.8 %	1.2 %	1.7 %
61-90	-	1.9 %	1.1 %	1.9 %
91-180	-	2.4 %	1.9 %	2.4 %
>180	-	2.4 %	2.1 %	2.4 %
Total	1.4 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %

*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**	19	155	4395	4549	5	48	2387	2559	20	89	3877	3538
Intragruo y off-shore***	0	0	2711	2611	0	0	1773	1640	0	0	2102	2495
Otros	155	19	524	464	48	5	146	100	89	20	398	344
Total	173	173	7630	7625	54	54	4305	4299	110	110	6377	6377

* 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.