

Fecha de Publicación: 09 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 05 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\$3756.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	724.7	836.9	311.0	454.7	280.4	24.5	245.5
15-35	668.8	884.6	760.9	510.6	6.8	41.3	116.9
36-60	444.4	46.7	34.0	177.0	12.7	267.4	0.0
61-90	163.8	69.0	0.0	0.0	48.0	142.8	21.0
91-180	46.4	111.4	82.3	0.0	9.1	26.4	20.0
>180	73.7	109.9	72.3	40.0	17.6	13.7	20.0
Total	2121.8	2058.5	1260.5	1182.3	374.6	516.0	423.4

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	2.1 %	1.9 %	2.1 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
36-60	-	4.0 %	2.2 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.1 %
91-180	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.4 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
Total	2.4 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de diciembre				9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	70	133	4495	4694	33	142	4685	5531	84	208	4601	5096
Intragruppo y off-shore***	0	0	2409	2299	0	0	2792	1668	0	0	2830	2455
Otros	133	70	1176	1086	142	33	1189	1459	208	84	1021	901
Total	203	203	8079	8079	175	175	8666	8658	293	293	8452	8452

* 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.