

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 06 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\$2877.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.4%.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	363.5	624.2	457.8	243.7	82.9	36.3	83.5
15-35	582.1	611.3	393.0	386.5	33.3	10.6	185.0
36-60	177.3	67.3	0.0	99.4	47.3	57.9	20.0
61-90	51.8	67.2	0.0	10.0	66.2	40.8	1.0
91-180	118.4	76.7	0.0	72.0	31.7	1.4	45.0
>180	315.8	230.9	150.0	234.0	5.9	6.8	75.0
Total	1609.0	1677.6	1000.7	1045.6	267.3	153.9	409.5

* 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	2.4 %	2.9 %	2.2 %	2.4 %
15-35	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
36-60	2.5 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
61-90	2.1 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
91-180	2.2 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.4 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %

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

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	130	4497	4695	34	145	5044	5902	85	214	4610	5338
Intragruppo y off-shore***	0	0	2409	2299	0	0	3025	1908	0	0	3055	2458
Otros	130	70	1177	1088	145	34	1246	1497	214	85	1036	904
Total	201	201	8083	8083	179	179	9315	9307	299	299	8700	8700

* 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.