

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 10 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\$3547.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	742.0	395.4	202.2	532.2	163.2	179.8	30.0
15-35	516.8	717.0	559.0	354.7	19.5	23.6	138.5
36-60	151.8	86.7	0.0	0.0	86.7	151.8	0.0
61-90	264.8	261.0	0.0	0.0	246.0	249.8	15.0
91-180	79.3	77.5	38.2	36.7	14.3	17.6	25.0
>180	181.3	342.3	250.0	84.4	32.3	36.9	60.0
Total	1936.0	1879.9	1049.4	1008.0	562.0	659.5	268.5

* 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	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	1.9 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.0 %	2.5 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.4 %	2.4 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %

*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	9 al 13 de diciembre				16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	141	5560	6139	90	214	5184	5843	13	127	2841	3801
Intragruppo y off-shore***	0	0	3180	2360	0	0	3285	2756	0	0	2521	1563
Otros	141	34	1278	1511	214	90	1219	1088	127	13	307	300
Total	174	174	10018	10010	304	304	9687	9687	140	140	5669	5664

* 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.