

Fecha de Publicación: 05 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 03 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\$2470.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	338.7	570.7	373.6	133.5	85.8	94.0	111.3
15-35	537.2	272.7	228.7	509.8	26.5	9.9	17.5
36-60	263.0	153.3	2.7	2.0	150.6	261.0	0.0
61-90	95.8	151.1	77.0	12.0	38.1	47.8	36.0
91-180	70.5	29.1	20.0	38.2	6.9	30.1	2.2
>180	98.9	121.4	50.0	2.0	6.4	31.9	65.0
Total	1404.1	1298.2	752.0	697.5	314.3	474.6	232.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.5 %	2.4 %	2.1 %	2.3 %
15-35	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.3 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.6 %	2.1 %	2.0 %	2.2 %
91-180	2.2 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
>180	2.5 %	2.7 %	2.3 %	2.5 %
Total	2.5 %	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.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	73	123	4104	4552	27	137	4165	5071	85	206	4329	4639
Intragrupa y off-shore***	0	0	2309	1944	0	0	2613	1354	0	0	2730	2319
Otros	123	73	1155	1072	137	27	1094	1439	206	85	777	877
Total	196	196	7568	7568	165	165	7872	7864	291	291	7835	7835

* 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.