Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 16 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$1741.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	324.0	244.6	121.0	237.0	49.6	13.0	74.0
15-35	594.6	516.0	271.0	369.0	55.5	36.1	189.5
36-60	40.8	22.3	0.0	0.0	22.3	40.8	0.0
61-90	6.7	31.6	10.0	0.0	21.6	6.7	0.0
91-180	43.9	57.5	0.0	40.0	57.5	3.9	0.0
>180	45.6	81.6	60.0	30.0	17.6	11.6	4.0
Total	**1055.7**	**953.5**	**462.0**	**676.0**	**224.0**	**112.2**	**267.5**

* 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	2.1 %	1.3 %	1.9 %	1.7 %
15-35	1.9 %	1.7 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	2.3 %	1.8 %	2.0 %
61-90	-	2.3 %	1.5 %	2.2 %
91-180	-	2.4 %	1.3 %	1.9 %
>180	2.4 %	2.5 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.9 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %

*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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	16 al 20 de diciembre				23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	91	203	6204	6673	17	135	3322	4035	5	41	1997	2341
Intragrupo y off-shore***	0	0	3781	3590	0	0	2526	1819	0	0	1678	1375
Otros	203	91	1398	1121	135	17	354	344	41	5	135	93
Total	**294**	**294**	**11383**	**11383**	**152**	**152**	**6202**	**6197**	**46**	**46**	**3809**	**3809**

* 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.