Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 20 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$1309.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.[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	147.0	117.3	65.2	115.6	24.9	4.2	27.2
15-35	443.0	579.3	262.7	150.5	50.4	26.3	266.2
36-60	18.0	16.6	0.0	0.0	16.6	18.0	0.0
61-90	143.4	35.3	18.5	133.2	11.7	5.2	5.0
91-180	8.9	39.2	13.9	0.0	20.3	3.9	5.0
>180	42.8	37.3	0.0	20.0	22.3	7.8	15.0
Total	**803.0**	**825.0**	**360.3**	**419.3**	**146.3**	**65.3**	**318.4**

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	2.0 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.5 %	1.6 %	1.6 %
36-60	-	2.2 %	1.6 %	1.9 %
61-90	1.8 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
91-180	2.0 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %
>180	2.4 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
Total	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %

*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

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**	93	216	6792	7055	17	151	4072	4389	5	49	2209	2418
Intragrupo y off-shore***	0	0	3969	4014	0	0	2614	2344	0	0	1727	1557
Otros	216	93	1453	1145	151	17	510	458	49	5	145	100
Total	**309**	**309**	**12215**	**12215**	**168**	**168**	**7196**	**7191**	**54**	**54**	**4081**	**4075**

* 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.