Fecha de Publicación: 30 de diciembre de 2019

Fecha de Información: 26 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$1407.5 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	455.0	280.2	30.5	143.0	87.7	150.0	162.0
15-35	317.5	277.0	81.1	169.3	98.9	51.2	97.0
36-60	51.2	26.8	5.0	26.2	21.8	25.1	0.0
61-90	1.1	70.5	5.0	0.0	65.5	1.1	0.0
91-180	23.4	65.6	5.7	19.0	57.3	1.8	2.6
>180	37.3	94.4	10.0	5.0	53.4	1.3	31.0
Total	**885.7**	**814.5**	**137.2**	**362.5**	**384.6**	**230.6**	**292.6**

* 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	1.4 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.1 %	1.5 %	1.8 %
61-90	-	2.1 %	1.2 %	2.1 %
91-180	2.2 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
>180	2.4 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
Total	1.5 %	2.0 %	1.4 %	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	23 al 27 de diciembre				30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	166	4435	4554	7	50	2523	2692	20	91	4164	3678
Intragrupo y off-shore***	0	0	2711	2625	0	0	1803	1671	0	0	2102	2593
Otros	166	17	529	491	50	7	222	178	91	20	402	398
Total	**183**	**183**	**7675**	**7670**	**57**	**57**	**4548**	**4542**	**112**	**112**	**6669**	**6669**

* 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.