

Fecha de Publicación: 2 de enero de 2020

Fecha de Información: 27 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\$1817.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	430.3	227.1	114.6	312.6	13.5	18.7	99.0
15-35	563.6	560.2	201.0	298.8	148.7	54.3	210.5
36-60	22.8	11.3	0.0	0.0	10.9	22.4	0.4
61-90	26.8	21.6	0.0	24.1	21.6	2.7	0.0
91-180	59.3	93.6	0.3	2.0	83.2	47.3	10.0
>180	95.5	74.9	0.0	30.0	25.5	16.1	49.4
Total	1198.3	988.7	315.9	667.5	303.5	161.5	369.3

* 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	1.6 %	1.6 %	1.7 %	1.6 %
15-35	1.5 %	1.7 %	1.4 %	1.5 %
36-60	2.0 %	2.0 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.2 %	1.7 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.5 %	1.8 %	2.3 %
>180	2.7 %	2.4 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.7 %	1.8 %	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

Sector	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	167	4433	4555	17	74	2686	2750	28	91	4416	3841
Intragrupa y off-shore***	0	0	2711	2625	0	0	1859	1833	0	0	2161	2743
Otros	167	17	530	489	74	17	224	180	90	28	407	400
Total	183	183	7674	7669	90	90	4769	4763	118	118	6984	6984

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.