

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2020

Fecha de Información: 30 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\$1315.4 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	106.9	39.4	6.0	80.0	13.4	6.8	20.0
15-35	573.9	327.6	159.5	449.0	68.6	25.4	99.5
36-60	27.3	162.0	106.9	0.0	35.1	7.3	20.0
61-90	2.9	34.7	0.0	0.0	34.7	2.9	0.0
91-180	26.8	104.5	0.0	0.0	83.5	5.8	21.0
>180	18.2	66.8	0.0	0.0	51.8	3.2	15.0
Total	755.9	735.0	272.4	529.0	287.1	51.4	175.5

* 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	1.4 %	1.8 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.5 %
36-60	1.6 %	1.9 %	1.1 %	1.8 %
61-90	-	2.1 %	-0.2 %	1.9 %
91-180	2.0 %	2.5 %	0.7 %	2.3 %
>180	2.6 %	2.7 %	1.4 %	2.6 %
Total	1.6 %	2.1 %	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

Sector	30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero				13 al 17 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	74	2768	2766	29	91	4421	3847	24	151	5113	4583
Intragrupa y off-shore***	0	0	1861	1906	0	0	2165	2746	0	0	2175	2162
Otros	74	17	233	184	91	29	410	403	151	24	1124	1667
Total	91	91	4862	4856	120	120	6996	6996	175	175	8412	8412

* 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.