

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2020

Fecha de Información: 09 de enero de 2020 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\$2294.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	360.2	516.6	262.7	97.4	5.5	14.3	248.5
15-35	699.4	745.0	381.3	312.8	49.5	72.4	314.2
36-60	112.7	39.8	30.0	105.0	9.8	7.7	0.0
61-90	250.7	32.1	0.0	225.0	7.1	0.7	25.0
91-180	5.1	23.0	0.0	0.0	23.0	5.1	0.0
>180	87.7	67.3	0.0	30.0	10.3	0.7	57.0
Total	1515.8	1423.7	673.9	770.2	105.1	100.9	644.7

* 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	1.7 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	2.3 %	1.8 %	1.8 %
61-90	2.0 %	2.5 %	2.1 %	2.1 %
91-180	-	2.7 %	2.1 %	2.6 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.3 %	2.6 %
Total	1.8 %	1.7 %	1.7 %	1.8 %

*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	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	99	5676	4901	28	156	6234	6042	15	190	3416	2894
Intragrupa y off-shore***	0	0	2418	3235	0	0	2810	2616	0	0	1460	1273
Otros	99	30	715	673	156	28	1309	1696	190	15	545	1168
Total	129	129	8809	8809	184	184	10353	10353	206	206	5421	5335

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