

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2020

Fecha de Información: 10 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\$1837.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	264.3	253.8	115.0	194.0	84.8	16.3	54.0
15-35	454.4	603.9	424.7	286.8	37.7	26.1	141.5
36-60	45.9	46.5	0.0	0.0	46.5	45.9	0.0
61-90	187.8	60.1	30.0	175.0	20.1	2.8	10.0
91-180	1.8	13.8	0.0	0.0	13.8	1.8	0.0
>180	57.8	77.9	45.0	30.0	7.9	2.8	25.0
Total	1011.9	1055.9	614.7	685.8	210.7	95.7	230.5

* 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	1.7 %	1.9 %	1.3 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.7 %	1.7 %	1.7 %
36-60	-	2.4 %	1.9 %	2.2 %
61-90	2.2 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	3.1 %	2.1 %	3.0 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %

* 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	98	5682	4902	28	155	6425	6215	17	193	3492	2971
Intragrupa y off-shore***	0	0	2418	3235	0	0	2905	2745	0	0	1480	1338
Otros	98	30	716	679	155	28	1344	1714	193	17	592	1169
Total	129	129	8816	8816	183	183	10674	10674	210	210	5564	5478

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