

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2020

Fecha de Información: 15 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\$2749.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	500.4	525.1	234.1	188.5	136.0	156.9	155.0
15-35	451.6	595.9	454.9	241.3	77.5	146.8	63.5
36-60	372.9	119.4	10.0	164.0	109.4	208.9	0.0
61-90	137.5	3.9	0.0	117.7	3.9	19.8	0.0
91-180	27.8	86.1	50.0	10.0	21.1	2.8	15.0
>180	84.7	97.4	50.7	48.4	26.7	16.4	20.0
Total	1574.9	1427.7	799.7	769.8	374.5	551.6	253.5

* 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	2.2 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
15-35	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	-	2.1 %	2.1 %	2.1 %
61-90	-	2.6 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.7 %	1.8 %	2.5 %
>180	2.7 %	3.1 %	2.7 %	2.8 %
Total	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %

*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	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	173	7187	7030	17	198	3807	3316	25	145	3677	3020
Intragrupa y off-shore***	0	0	3464	3217	0	0	1545	1409	0	0	956	1309
Otros	173	25	1340	1743	198	17	793	1333	145	25	980	1284
Total	198	198	11990	11990	215	215	6144	6058	169	169	5613	5613

* 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.