

Fecha de Publicación: 21 de enero de 2020

Fecha de Información: 17 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\$1377.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	125.3	200.5	130.0	45.3	5.5	15.0	65.0
15-35	520.9	489.2	155.6	133.5	136.1	189.9	197.5
36-60	46.9	17.5	0.0	0.0	17.5	46.9	0.0
61-90	32.8	48.4	40.0	10.0	8.4	22.8	0.0
91-180	75.8	72.5	10.0	22.0	12.5	3.8	50.0
>180	24.9	35.7	30.0	10.0	5.7	14.9	0.0
Total	826.5	863.7	365.6	220.8	185.7	293.2	312.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	1.9 %	-2.4 %	1.1 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.4 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.3 %	2.2 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.6 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.7 %	2.6 %	2.6 %
Total	2.0 %	2.1 %	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.

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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	7224	7097	21	199	4030	3483	24	143	3826	3301
Intragruppo y off-shore***	0	0	3524	3249	0	0	1647	1513	0	0	1153	1362
Otros	173	25	1346	1748	199	21	808	1404	143	24	1018	1335
Total	199	199	12094	12094	220	220	6486	6400	167	167	5997	5997

* 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.