Fecha de Publicación: 24 de enero de 2020

Fecha de Información: 22 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$1660.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	350.7	329.8	87.0	157.5	98.8	49.2	144.0
15-35	385.3	536.3	344.5	192.4	58.4	59.5	133.4
36-60	107.3	74.0	0.0	0.0	51.0	84.3	23.0
61-90	6.6	12.4	0.0	1.0	12.4	5.6	0.0
91-180	8.1	41.8	10.0	0.0	29.8	6.1	2.0
>180	83.8	62.1	13.0	24.0	14.1	24.8	35.0
Total	**941.8**	**1056.3**	**454.5**	**374.9**	**264.4**	**229.5**	**337.4**

* 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 %	2.2 %	1.8 %	2.1 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.3 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.4 %
91-180	2.4 %	2.7 %	2.1 %	2.6 %
>180	2.6 %	3.0 %	2.4 %	2.6 %
Total	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.2 %

*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

Sectores	20 al 24 de enero				27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	195	4551	4355	24	138	4075	3615	23	112	3274	2865
Intragrupo y off-shore***	0	0	1858	1801	0	0	1268	1503	0	0	1242	1401
Otros	195	19	1247	1414	138	24	1161	1385	112	23	540	791
Total	**214**	**214**	**7656**	**7570**	**163**	**163**	**6504**	**6504**	**134**	**134**	**5056**	**5056**

* 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.