Fecha de Publicación: 27 de enero de 2020

Fecha de Información: 23 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$2272.1 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	245.0	342.7	144.0	28.5	168.7	186.5	30.0
15-35	800.6	489.7	252.5	356.0	159.6	367.0	77.6
36-60	20.5	1.5	0.0	0.0	1.5	20.5	0.0
61-90	23.8	22.8	14.1	10.0	3.8	8.8	5.0
91-180	25.7	59.7	35.0	0.0	9.7	10.7	15.0
>180	159.3	228.4	205.5	20.0	2.8	119.1	20.2
Total	**1275.0**	**1144.9**	**651.0**	**414.5**	**346.1**	**712.6**	**147.8**

* 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	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
15-35	1.9 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	0.0 %	2.8 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.3 %	2.7 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.1 %	2.3 %	2.1 %	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**	17	202	4611	4489	26	138	4249	3779	23	110	3285	2912
Intragrupo y off-shore***	0	0	1955	1827	0	0	1299	1506	0	0	1258	1401
Otros	202	17	1253	1417	138	26	1295	1557	110	23	571	802
Total	**220**	**220**	**7819**	**7733**	**164**	**164**	**6842**	**6842**	**132**	**132**	**5114**	**5114**

* 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.