

Fecha de Publicación: 3 de febrero de 2020

Fecha de Información: 30 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\$2918.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	444.5	427.7	105.0	151.5	221.5	191.8	101.2
15-35	824.9	990.4	456.3	293.7	148.7	145.7	385.5
36-60	69.5	34.9	19.9	0.0	15.0	69.5	0.0
61-90	322.5	278.2	150.0	160.0	16.0	50.3	112.2
91-180	32.8	16.4	2.5	0.0	13.9	32.8	0.0
>180	54.2	42.8	20.0	0.0	1.8	33.2	21.0
Total	1748.4	1790.4	753.6	605.2	416.9	523.3	619.9

* 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 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.5 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.3 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.4 %	2.5 %
Total	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %

*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	27 al 31 de enero				3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	171	5132	4636	28	109	3852	3487	37	181	3565	3877
Intragrupa y off-shore***	0	0	1707	1911	0	0	1323	1528	0	0	2017	1378
Otros	171	21	1337	1629	109	28	846	1007	181	37	738	1067
Total	191	191	8176	8176	138	138	6021	6021	218	218	6321	6321

* 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.