

Fecha de Publicación: 4 de febrero de 2020

Fecha de Información: 31 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\$1611.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.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	457.3	579.6	178.5	92.2	53.6	17.6	347.5
15-35	282.4	383.5	208.9	106.8	105.1	106.1	69.5
36-60	129.9	115.5	0.0	0.0	15.5	29.9	100.0
61-90	78.9	30.7	0.0	0.0	5.0	53.2	25.7
91-180	33.4	16.1	0.0	0.0	16.1	33.4	0.0
>180	35.1	12.1	10.0	30.0	2.1	5.1	0.0
Total	1017.0	1137.6	397.4	229.0	197.4	245.3	542.7

* 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 %	1.7 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
36-60	2.1 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.6 %	2.1 %	2.2 %
91-180	-	2.7 %	2.3 %	2.4 %
>180	-	2.5 %	2.3 %	2.5 %
Total	2.0 %	2.1 %	1.9 %	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	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**	20	169	5132	4638	25	119	4159	3836	38	183	3715	4098
Intragruppo y off-shore***	0	0	1707	1911	0	0	1402	1595	0	0	2117	1403
Otros	169	20	1339	1630	119	25	889	1019	183	38	740	1071
Total	189	189	8178	8178	144	144	6450	6450	221	221	6572	6572

* 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 intragruppo.