

Fecha de Publicación: 09 de enero de 2020

Fecha de Información: 07 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\$2392.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.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	737.1	541.6	219.5	550.9	141.1	5.2	181.0
15-35	613.6	533.7	238.8	344.8	60.1	33.9	234.9
36-60	68.3	43.8	3.3	0.0	10.5	38.3	30.0
61-90	161.3	56.8	11.1	93.7	45.7	67.7	0.0
91-180	30.5	60.7	0.0	0.0	30.7	0.5	30.0
>180	10.5	16.6	0.0	0.0	10.6	4.5	6.0
Total	1621.3	1253.2	472.6	989.3	298.7	150.0	481.9

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.8 %	2.2 %	1.6 %	1.8 %
61-90	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.6 %	2.0 %	2.3 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.4 %	2.6 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %

* 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	6 al 10 de enero				13 al 17 de enero				20 al 24 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	92	5364	4487	28	157	5569	5079	16	189	3257	2780
Intragruppo y off-shore***	0	0	2297	3163	0	0	2426	2454	0	0	1436	1218
Otros	92	30	627	638	157	28	1128	1589	189	16	521	1129
Total	122	122	8288	8288	185	185	9123	9123	205	205	5214	5128

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\Delta} (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.