

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2020

Fecha de Información: 16 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\$2162.5 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	279.3	309.0	229.5	143.0	49.5	106.3	30.0
15-35	548.2	557.8	305.8	281.3	137.8	152.6	114.3
36-60	83.9	148.3	0.0	0.0	148.3	83.9	0.0
61-90	6.6	13.1	0.0	0.0	13.1	6.6	0.0
91-180	71.4	5.2	0.0	50.0	5.2	21.4	0.0
>180	155.7	129.3	70.0	134.7	58.3	20.0	1.0
Total	1145.1	1162.7	605.3	609.0	412.1	390.9	145.3

* 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 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.6 %	2.1 %	2.5 %
91-180	-	3.1 %	2.3 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.7 %	2.7 %	2.7 %
Total	2.2 %	2.2 %	2.2 %	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	13 al 17 de enero				20 al 24 de enero				27 al 31 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	174	7223	7095	18	200	3965	3376	24	142	3769	3204
Intragrupo y off-shore***	0	0	3524	3249	0	0	1572	1482	0	0	1098	1347
Otros	174	25	1345	1748	200	18	800	1393	142	24	1016	1332
Total	199	199	12092	12092	218	218	6337	6251	166	166	5883	5883

* 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.