

Fecha de Publicación: 22 de enero de 2020

Fecha de Información: 20 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\$686.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	138.8	103.9	76.7	118.7	7.3	0.1	20.0
15-35	272.1	278.4	35.4	27.9	3.0	4.2	240.0
36-60	23.7	5.3	4.5	11.0	0.8	12.7	0.0
61-90	5.1	29.2	28.1	1.0	1.1	4.1	0.0
91-180	1.7	13.4	6.7	0.3	6.8	1.5	0.0
>180	48.4	26.4	25.1	48.4	1.3	0.0	0.0
Total	489.8	456.7	176.5	207.1	20.2	22.7	260.0

* 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	1.7 %		2.1 %	1.3 %	1.8 %
15-35	1.9 %		2.2 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-		3.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-		3.0 %	2.1 %	2.3 %
91-180	-		2.7 %	2.3 %	2.6 %
>180	-		2.9 %	-	2.9 %
Total	1.9 %		2.2 %	1.6 %	1.9 %

*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**	20	199	4092	3567	24	143	3906	3329	21	111	3239	2776
Intragrupo y off-shore***	0	0	1710	1552	0	0	1178	1441	0	0	1205	1401
Otros	199	20	809	1406	143	24	1021	1335	111	21	506	774
Total	219	219	6611	6525	167	167	6105	6105	132	132	4951	4951

* 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.