

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2020

Fecha de Información: 28 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\$2054.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	307.0	277.9	81.3	117.5	19.7	12.5	177.0
15-35	495.9	469.9	256.5	274.6	90.6	98.6	122.8
36-60	283.0	312.6	70.0	15.4	141.1	166.1	101.5
61-90	22.3	10.0	0.1	0.0	9.8	22.3	0.0
91-180	92.6	90.9	20.2	2.5	19.7	39.1	51.0
>180	105.7	69.0	17.0	4.0	22.0	71.7	30.0
Total	1306.6	1230.3	445.0	414.0	303.0	410.3	482.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	2.2 %	1.8 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.1 %	2.2 %	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	169	4755	4267	21	107	3477	3122	28	177	3390	3796
Intragruppo y off-shore***	0	0	1521	1705	0	0	1281	1465	0	0	1984	1314
Otros	169	21	1319	1623	107	21	653	825	177	28	717	981
Total	189	189	7596	7596	128	128	5412	5412	205	205	6091	6091

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