

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2020

Fecha de Información: 29 de enero de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1929.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	391.9	370.4	154.5	145.5	6.9	37.4	209.0
15-35	583.4	510.0	250.3	204.6	92.4	211.3	167.4
36-60	84.5	93.1	30.0	12.5	58.1	67.0	5.0
61-90	83.7	73.8	50.0	0.0	8.8	68.7	15.0
91-180	32.7	49.1	0.0	5.0	48.1	26.7	1.0
>180	20.5	33.7	29.0	13.3	4.7	7.2	0.0
Total	1196.7	1130.2	513.8	380.9	219.0	418.4	397.4

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.5 %	1.7 %	1.7 %
15-35	2.0 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
36-60	2.2 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	2.3 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.5 %	2.5 %	2.3 %	2.5 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.5 %
Total	1.9 %	1.9 %	1.8 %	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	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	170	4975	4543	28	108	3631	3212	37	177	3493	3811
Intragruo y off-shore***	0	0	1668	1798	0	0	1284	1518	0	0	1989	1349
Otros	170	21	1323	1625	108	28	657	841	177	37	716	1038
Total	190	190	7966	7966	135	135	5572	5572	213	213	6199	6199

* 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 intragruo.