

Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2020

Fecha de Información: 03 de febrero 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\$2057.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	236.4	369.6	192.5	96.1	49.6	12.8	127.5
15-35	954.2	736.3	184.8	299.8	65.9	168.8	485.7
36-60	64.1	99.9	40.0	20.0	59.9	44.1	0.0
61-90	11.9	15.1	10.0	2.8	5.1	9.1	0.0
91-180	54.2	5.7	0.0	10.0	5.7	44.2	0.0
>180	57.6	65.4	61.6	13.0	3.9	44.6	0.0
Total	1378.4	1292.0	488.8	441.6	189.9	323.5	613.2

* 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	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	-	2.5 %	2.2 %	2.3 %
91-180	-	2.7 %	2.4 %	2.4 %
>180	-	2.5 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.9 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %

*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	3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	124	4287	4081	38	187	3823	4213	55	134	4359	3551
Intragrupa y off-shore***	0	0	1574	1686	0	0	2138	1408	0	0	1461	1558
Otros	124	23	927	1020	187	38	742	1082	134	55	716	1428
Total	147	147	6788	6788	225	225	6703	6703	189	189	6537	6537

* 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.