

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2020

Fecha de Información: 05 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\$2413.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	360.2	507.2	269.4	276.5	175.8	21.7	62.0
15-35	730.7	590.5	258.7	434.3	164.3	129.0	167.5
36-60	125.5	117.8	100.0	100.0	11.8	19.5	6.0
61-90	39.5	118.4	110.0	0.0	3.4	34.5	5.0
91-180	10.7	26.4	0.0	0.0	21.4	5.7	5.0
>180	12.2	29.4	10.0	0.0	9.4	2.2	10.0
Total	1278.8	1389.7	748.1	810.8	386.1	212.5	255.5

* 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	1.6 %	2.0 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	2.0 %	2.1 %	1.6 %	2.0 %
61-90	2.2 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.6 %	2.2 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.8 %	2.4 %	2.6 %
Total	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %

*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**	20	131	4630	4486	38	186	4048	4499	56	135	4486	3710
Intragrupa y off-shore***	0	0	1868	1926	0	0	2201	1600	0	0	1522	1583
Otros	131	20	953	1040	186	38	945	1094	135	56	724	1438
Total	151	151	7451	7451	224	224	7194	7194	191	191	6732	6732

* 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.