

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2020

Fecha de Información: 10 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\$2152.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.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	231.9	355.1	234.9	95.5	17.2	33.4	103.0
15-35	668.4	701.6	315.6	331.6	138.0	88.8	248.0
36-60	142.1	227.7	175.0	21.0	1.7	70.1	51.0
61-90	30.9	32.3	30.0	20.0	1.3	9.9	1.0
91-180	24.3	25.9	1.2	0.0	24.7	24.3	0.0
>180	94.6	30.3	20.0	60.0	0.3	24.6	10.0
Total	1192.3	1373.0	776.7	528.1	183.3	251.1	413.0

* 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	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	2.2 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.4 %	2.1 %	2.2 %
91-180	-	2.6 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.5 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
Total	1.9 %	2.0 %	1.9 %	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	10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero				24 al 28 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	179	4534	5099	57	137	4711	4093	20	136	5417	5250
Intragrupa y off-shore***	0	0	2536	1725	0	0	1660	1632	0	0	1925	1947
Otros	179	37	1045	1292	136	57	833	1479	136	20	1347	1493
Total	216	216	8115	8115	194	194	7205	7205	156	156	8689	8689

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