

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2020

Fecha de Información: 11 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\$2787.1 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	567.4	508.4	211.1	187.1	20.3	103.3	277.0
15-35	881.3	755.8	299.3	404.4	146.3	166.7	310.2
36-60	144.5	246.3	85.0	1.5	31.3	13.0	130.0
61-90	95.6	111.8	30.0	28.9	21.8	6.7	60.0
91-180	27.1	60.0	0.3	0.0	57.4	24.9	2.3
>180	92.6	92.6	72.4	70.0	3.2	5.6	17.0
Total	1808.6	1774.9	698.1	691.9	280.4	320.2	796.5

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

Sector	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**	35	145	4755	5360	58	135	5013	4339	23	135	5538	5345
Intragrupa y off-shore***	0	0	2687	1842	0	0	1676	1675	0	0	1989	2020
Otros	145	35	1091	1330	135	58	850	1526	135	23	1358	1520
Total	180	180	8533	8533	193	193	7539	7539	158	158	8886	8886

* 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.