

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2020

Fecha de Información: 13 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\$2457.2 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	436.6	236.6	33.0	79.0	149.1	303.1	54.5
15-35	659.4	542.8	231.0	289.5	146.3	204.4	165.5
36-60	120.9	207.0	0.0	0.0	177.0	90.9	30.0
61-90	45.0	83.1	30.0	20.0	38.1	10.0	15.0
91-180	98.5	163.3	41.1	50.0	87.1	13.3	35.2
>180	77.5	96.7	70.0	40.0	16.7	27.5	10.0
Total	1437.9	1329.5	405.1	478.5	614.2	649.2	310.2

* 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	1.7 %	2.2 %	2.0 %	2.0 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	2.0 %	2.1 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.5 %	2.1 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.5 %	2.2 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.3 %	1.6 %	2.0 %
Total	2.0 %	2.2 %	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**	34	140	5602	5595	59	138	5225	4596	23	138	5699	5463
Intragrupa y off-shore***	0	0	2746	2420	0	0	1726	1706	0	0	2034	2049
Otros	140	34	1118	1451	138	59	1026	1675	138	23	1366	1587
Total	174	174	9466	9466	196	196	7977	7977	161	161	9099	9099

* 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.