

Fecha de Publicación: 18 de febrero de 2020

Fecha de Información: 14 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\$1006.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	112.6	113.9	68.0	29.6	4.9	41.9	41.0
15-35	489.5	379.1	111.6	178.0	15.5	59.5	252.0
36-60	2.1	16.5	1.7	0.0	14.0	1.3	0.8
61-90	68.7	101.3	0.0	0.0	34.3	1.7	67.0
91-180	5.3	43.9	0.0	0.0	38.9	0.3	5.0
>180	18.0	38.1	20.0	0.0	1.1	1.0	17.0
Total	696.0	692.9	201.3	207.6	108.8	105.6	382.8

* 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 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	2.0 %	2.4 %	1.1 %	2.3 %
61-90	2.2 %	2.3 %	1.9 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.7 %	2.2 %	2.7 %
>180	2.5 %	2.7 %	2.4 %	2.5 %
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

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**	34	141	5602	5596	59	140	5277	4697	20	137	5758	5475
Intragruppo y off-shore***	0	0	2746	2420	0	0	1794	1724	0	0	2034	2061
Otros	141	34	1118	1451	140	59	1028	1678	137	20	1368	1624
Total	175	175	9467	9467	198	198	8099	8099	158	158	9161	9161

* 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.