

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2020

Fecha de Información: 17 de febrero de 2020 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$237.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48.4	62.6	22.0	3.0	2.6	7.4	38.0
15-35	87.6	101.4	47.0	30.0	2.4	5.6	52.0
36-60	13.7	0.1	0.0	0.0	0.1	13.7	0.0
61-90	1.3	2.0	1.7	0.0	0.3	1.3	0.0
91-180	1.9	4.0	0.0	0.0	4.0	1.9	0.0
>180	3.6	0.5	0.0	0.0	0.5	3.6	0.0
<b>Total</b>	<b>156.4</b>	<b>170.6</b>	<b>70.7</b>	<b>33.0</b>	<b>9.9</b>	<b>33.4</b>	<b>90.0</b>

\* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.0 %	2.0 %	1.0 %	1.3 %
15-35	1.9 %	2.1 %	1.9 %	1.9 %
36-60	-	3.5 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.4 %	1.5 %	2.1 %
91-180	-	2.7 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	2.6 %	2.3 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.8 %</b>

\* 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	17 al 21 de febrero				24 al 28 de febrero				2 al 6 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	56	143	5320	4756	20	136	5764	5475	16	82	4690	3803
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1816	1727	0	0	2034	2061	0	0	1573	2113
<b>Otros</b>	143	56	1027	1680	136	20	1368	1630	82	16	880	1221
<b>Total</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>8163</b>	<b>8163</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>9167</b>	<b>9167</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>7143</b>	<b>7138</b>

\* 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.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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 intragruppo.