

Fecha de Publicación: 11 de febrero de 2020

Fecha de Información: 07 de febrero de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1844.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	166.9	356.6	201.5	50.0	87.1	48.9	68.0
15-35	487.4	648.1	316.2	176.0	39.9	19.4	292.0
36-60	62.3	35.5	0.0	15.9	4.5	15.4	31.0
61-90	65.5	127.1	65.0	15.0	27.1	15.5	35.0
91-180	19.2	7.7	0.0	0.0	7.7	19.2	0.0
>180	252.1	127.1	33.0	156.0	9.1	11.1	85.0
Total	1053.4	1302.1	615.7	412.9	175.5	129.5	511.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.8 %	1.3 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	2.1 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
61-90	2.3 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
91-180	-	3.0 %	1.8 %	2.2 %
>180	2.6 %	2.7 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.0 %	1.9 %	1.8 %	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	3 al 7 de febrero				10 al 14 de febrero				17 al 21 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	133	4705	4678	39	189	4409	4824	56	134	4616	4046
Intragruo y off-shore***	0	0	1926	1961	0	0	2363	1675	0	0	1628	1586
Otros	133	21	1056	1050	189	39	1015	1288	134	56	838	1450
Total	154	154	7688	7688	228	228	7787	7787	191	191	7082	7082

* 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 intragruo.