

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2020

Fecha de Información: 12 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\$2884.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.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	750.8	382.0	130.5	532.5	59.5	26.3	192.0
15-35	794.6	987.2	591.5	322.3	86.7	163.4	309.0
36-60	65.9	56.4	10.0	0.0	46.4	65.9	0.0
61-90	81.7	62.5	0.0	40.0	37.5	16.7	25.0
91-180	60.6	82.0	0.0	0.0	22.0	0.6	60.0
>180	70.6	136.2	70.0	10.0	6.2	0.6	60.0
Total	1824.1	1706.4	802.0	904.8	258.4	273.3	646.0

* 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 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
91-180	2.4 %	2.7 %	2.1 %	2.5 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.5 %	2.5 %
Total	2.0 %	2.0 %	1.6 %	1.8 %

*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	150	5410	5570	59	137	5076	4419	23	137	5602	5429
Intragruo y off-shore***	0	0	2746	2347	0	0	1694	1703	0	0	2043	2046
Otros	150	34	1099	1339	137	59	892	1540	137	23	1360	1529
Total	184	184	9255	9255	196	196	7662	7662	160	160	9004	9004

* 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.