

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2020

Fecha de Información: 19 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\$2837.8 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	519.8	372.1	188.4	338.0	19.7	17.8	164.0
15-35	748.7	688.0	284.1	351.0	83.3	77.1	320.7
36-60	55.9	36.8	10.0	0.0	22.8	51.9	4.0
61-90	315.1	293.2	4.4	22.3	247.8	251.8	41.0
91-180	38.8	167.7	125.0	0.0	17.7	13.8	25.0
>180	88.2	155.6	30.0	0.0	38.2	0.8	87.4
Total	1766.4	1713.4	641.9	711.3	429.4	413.1	642.1

* 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	1.9 %	1.7 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	1.9 %
36-60	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.3 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
91-180	2.4 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
>180	2.6 %	2.7 %	2.2 %	2.6 %
Total	2.1 %	2.1 %	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	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
Sector Financiero**	56	150	5537	5480	18	137	6061	5659	17	80	5020	4041
Intragruppo y off-shore***	0	0	2032	1867	0	0	2134	2270	0	0	1598	2218
Otros	150	56	1465	1687	137	18	1396	1662	80	17	883	1237
Total	206	206	9034	9034	155	155	9591	9591	97	97	7502	7497

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.