

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2020

Fecha de Información: 20 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\$2252.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	357.3	322.8	85.8	121.2	116.0	115.1	121.0
15-35	516.7	604.5	214.1	187.0	195.9	135.2	194.5
36-60	55.9	94.0	0.0	0.0	94.0	55.9	0.0
61-90	212.6	202.0	0.0	15.0	137.0	132.6	65.0
91-180	32.8	39.5	15.0	10.0	9.5	7.8	15.0
>180	128.5	146.5	63.0	39.0	18.5	24.5	65.0
Total	1303.7	1409.3	377.8	372.2	571.0	471.0	460.5

* 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	
3-14	2.0 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.2 %	2.4 %
>180	2.7 %	2.6 %	2.5 %	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	154	5677	5623	19	136	6221	5790	17	80	5071	4095
Intragrupo y off-shore***	0	0	2077	1918	0	0	2155	2320	0	0	1622	2241
Otros	154	56	1472	1685	136	19	1502	1768	80	17	885	1238
Total	210	210	9226	9226	156	156	9878	9878	98	98	7579	7574

* 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.