

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2020

Fecha de Información: 21 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\$2014.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	362.1	297.1	83.0	162.5	48.1	33.6	166.0
15-35	711.4	498.8	221.0	369.9	88.5	152.2	189.3
36-60	17.4	43.3	0.0	0.0	43.3	17.4	0.0
61-90	177.0	122.6	0.0	3.7	112.6	163.3	10.0
91-180	17.9	46.2	0.0	16.2	46.2	1.7	0.0
>180	42.1	43.8	30.0	27.3	13.8	14.8	0.0
Total	1327.9	1051.7	334.0	579.5	352.4	383.1	365.3

* 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	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	2.6 %	1.0 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	2.0 %	2.2 %
61-90	2.2 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
91-180	-	2.6 %	1.8 %	2.5 %
>180	-	2.8 %	2.5 %	2.6 %
Total	2.0 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %

*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	155	5682	5625	20	144	6434	6025	17	82	5213	4146
Intragruppo y off-shore***	0	0	2077	1918	0	0	2235	2396	0	0	1625	2328
Otros	155	56	1475	1690	144	20	1537	1785	82	17	888	1247
Total	211	211	9233	9233	164	164	10205	10205	100	100	7726	7721

* 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.