

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2321.6 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	406.8	482.0	231.0	166.8	22.5	11.6	228.5
15-35	764.4	622.5	264.3	251.5	106.6	261.4	251.5
36-60	113.1	78.2	2.8	10.0	75.5	103.1	0.0
61-90	82.5	142.9	60.0	0.0	52.9	52.5	30.0
91-180	18.9	4.1	2.0	0.0	2.1	18.9	0.0
>180	90.3	35.9	0.0	20.0	25.9	60.3	10.0
Total	1476.0	1365.7	560.1	448.3	285.6	507.7	520.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.1 %	1.5 %	1.6 %	1.7 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.3 %	2.1 %	2.2 %
61-90	2.4 %	2.3 %	2.2 %	2.3 %
91-180	-	2.7 %	2.0 %	2.1 %
>180	2.5 %	2.6 %	2.2 %	2.4 %
Total	2.1 %	2.0 %	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	24 al 28 de febrero				2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	137	6618	6404	17	83	5398	4246	16	117	4215	4253
Intragrupo y off-shore***	0	0	2466	2459	0	0	1625	2419	0	0	1636	1584
Otros	137	16	1567	1788	83	17	897	1252	117	16	1240	1254
Total	153	153	10651	10651	99	99	7921	7916	133	133	7091	7091

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