

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2020

Fecha de Información: 25 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\$2657.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.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	471.8	423.3	261.0	301.1	17.3	25.8	145.0
15-35	707.6	767.5	268.6	175.0	193.5	227.2	305.4
36-60	190.7	232.3	31.0	0.0	201.3	190.7	0.0
61-90	88.6	77.4	3.8	0.0	51.0	66.0	22.6
91-180	10.2	9.7	2.0	0.0	6.7	9.2	1.0
>180	106.1	108.1	29.6	35.0	16.4	9.1	62.0
Total	1575.0	1618.2	596.1	511.1	486.2	528.0	535.9

* 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	1.9 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.0 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.2 %	2.1 %	2.1 %
61-90	2.3 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
91-180	2.4 %	2.7 %	2.3 %	2.5 %
>180	2.6 %	2.6 %	2.6 %	2.6 %
Total	2.1 %	2.1 %	2.0 %	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	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**	17	145	6868	6614	16	83	5524	4393	16	117	4316	4328
Intragrupo y off-shore***	0	0	2648	2685	0	0	1704	2465	0	0	1641	1618
Otros	145	17	1576	1793	83	16	906	1271	117	16	1243	1254
Total	162	162	11092	11092	99	99	8134	8129	133	133	7200	7200

* 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 intragrupo.