

Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2020

Fecha de Información: 27 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\$3170.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	291.6	340.7	188.3	106.0	27.5	60.6	125.0
15-35	465.3	902.7	585.0	133.0	162.6	177.2	155.1
36-60	21.1	13.0	0.0	2.8	13.0	18.3	0.0
61-90	201.0	177.2	25.0	1.8	2.2	49.2	150.0
91-180	119.2	65.5	10.0	37.4	40.5	66.8	15.0
>180	689.9	382.4	305.1	496.7	22.7	138.6	54.6
Total	1788.2	1881.5	1113.3	777.7	268.4	510.8	499.7

* 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 intragruo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %		1.9 %	1.1 %	1.6 %
15-35	1.7 %		2.3 %	1.7 %	2.0 %
36-60	-		2.2 %	1.6 %	1.8 %
61-90	2.0 %		2.1 %	1.9 %	2.0 %
91-180	2.2 %		2.4 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.5 %		2.5 %	2.5 %	2.5 %
Total	1.9 %		2.2 %	1.8 %	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**	18	158	7257	6809	20	79	5791	4762	20	116	4602	4730
Intragruo y off-shore***	0	0	2747	2993	0	0	1856	2506	0	0	1946	1748
Otros	158	18	1604	1805	79	20	1053	1425	116	20	1258	1328
Total	175	175	11607	11607	99	99	8699	8694	136	136	7806	7806

* 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 intragruo.