

Fecha de Publicación: 3 de marzo de 2020

Fecha de Información: 28 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\$1912.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.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	206.8	255.8	155.6	119.0	45.5	33.2	54.7
15-35	604.0	549.4	326.6	343.5	51.6	89.3	171.2
36-60	68.8	6.0	0.0	15.0	6.0	53.8	0.0
61-90	18.3	13.4	0.8	6.7	12.6	11.6	0.0
91-180	48.1	255.8	190.0	4.1	40.8	19.0	25.0
>180	119.8	27.2	15.0	24.8	2.2	85.0	10.0
Total	1065.8	1107.6	688.0	513.1	158.7	291.8	260.9

* 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	0.2 %	1.6 %	1.3 %	1.2 %
15-35	1.6 %	1.8 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	2.3 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.5 %	1.8 %
91-180	1.9 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.9 %	2.4 %	2.4 %	2.4 %
Total	1.4 %	1.8 %	1.6 %	1.6 %

*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	157	7257	6811	19	91	5953	4906	20	116	4646	4833
Intragruppo y off-shore***	0	0	2747	2993	0	0	1924	2602	0	0	2033	1771
Otros	157	17	1605	1805	91	19	1076	1440	116	20	1271	1347
Total	175	175	11609	11609	109	109	8953	8948	136	136	7951	7951

* 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.