

Fecha de Publicación: 4 de marzo de 2020

Fecha de Información: 02 de marzo 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\$2532.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.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	449.3	262.8	147.8	283.0	32.0	83.3	83.0
15-35	641.8	729.7	403.0	343.0	115.7	87.8	211.0
36-60	327.5	245.5	25.5	12.6	107.0	201.9	113.0
61-90	9.5	67.9	0.1	0.7	67.8	8.8	0.0
91-180	64.5	45.1	0.3	20.0	4.8	4.5	40.0
>180	112.3	43.1	20.0	45.0	3.1	47.3	20.0
Total	1604.9	1394.1	596.8	704.3	330.4	433.6	467.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.5 %	1.2 %	0.9 %	0.9 %
15-35	1.1 %	1.8 %	1.1 %	1.4 %
36-60	1.4 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.7 %
91-180	2.0 %	2.6 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.7 %	2.9 %	2.3 %	2.4 %
Total	1.2 %	1.7 %	1.3 %	1.4 %

*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	2 al 6 de marzo				9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	100	6169	5088	20	115	4830	4863	25	139	5748	4864
Intragruppo y off-shore***	0	0	2060	2775	0	0	2045	1872	0	0	1802	2092
Otros	100	19	1087	1448	115	20	1282	1422	139	25	1003	1597
Total	118	118	9316	9311	135	135	8157	8157	164	164	8553	8553

* 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 intragruppo.