

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2020

Fecha de Información: 03 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\$3362.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.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	423.0	397.2	182.4	176.9	73.8	105.1	141.0
15-35	943.7	987.5	617.3	400.7	42.8	215.6	327.5
36-60	229.4	205.1	20.0	0.0	145.1	189.4	40.0
61-90	51.1	29.2	0.0	0.0	29.2	51.1	0.0
91-180	178.9	48.6	0.0	129.0	13.6	14.9	35.0
>180	226.1	257.9	161.0	98.0	24.9	56.1	72.0
Total	2052.2	1925.5	980.7	804.6	329.3	632.2	615.5

* 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	1.1 %	1.1 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.1 %	1.5 %	1.0 %	1.2 %
36-60	1.8 %	1.5 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	2.1 %	1.8 %	1.9 %
91-180	2.1 %	2.3 %	2.1 %	2.2 %
>180	2.7 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
Total	1.4 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %

* 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**	22	98	6346	5271	27	116	5032	5068	26	141	5958	5001
Intragruppo y off-shore***	0	0	2155	2868	0	0	2122	1905	0	0	1813	2152
Otros	98	22	1104	1461	116	27	1340	1520	141	26	1009	1628
Total	120	120	9605	9600	142	142	8493	8493	167	167	8781	8781

* 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 intragruppo.