

Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2020

Fecha de Información: 04 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\$3104.8 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	412.9	474.4	287.0	212.5	152.4	165.4	35.0
15-35	583.3	1013.1	606.2	183.5	126.9	119.8	280.0
36-60	178.3	35.7	0.0	0.0	35.7	178.3	0.0
61-90	57.4	62.7	0.0	0.0	7.7	2.4	55.0
91-180	217.3	64.7	10.0	175.0	34.7	22.3	20.0
>180	295.9	156.2	98.5	78.5	0.7	160.4	57.0
Total	1745.1	1806.7	1001.7	649.5	358.0	648.6	447.0

* 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	1.4 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.4 %	1.5 %	1.2 %	1.4 %
36-60	-	1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.9 %	2.3 %	1.7 %	2.0 %
91-180	2.3 %	2.5 %	2.3 %	2.3 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.5 %	2.6 %
Total	1.7 %	1.5 %	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	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	101	6520	5570	21	116	5401	5388	26	141	6154	5124
Intragruppo y off-shore***	0	0	2444	3034	0	0	2275	2092	0	0	1869	2278
Otros	101	19	1114	1469	116	21	1481	1678	141	26	1060	1680
Total	121	121	10079	10074	137	137	9157	9157	166	166	9083	9083

* 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.