

Fecha de Publicación: 9 de marzo de 2020

Fecha de Información: 05 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\$2472.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	230.8	375.0	323.4	122.4	7.6	64.4	44.0
15-35	510.6	986.0	634.7	201.2	69.8	27.9	281.5
36-60	121.1	18.9	0.1	35.3	18.8	85.8	0.0
61-90	272.6	10.5	0.0	240.0	0.5	22.6	10.0
91-180	55.4	5.7	3.2	0.0	2.4	55.4	0.0
>180	157.4	91.3	58.0	62.2	6.3	68.3	27.0
Total	1348.0	1487.3	1019.4	661.1	105.5	324.4	362.5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	1.7 %	1.2 %	1.6 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.0 %	1.7 %	1.8 %
61-90	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.2 %
91-180	-	2.8 %	2.1 %	2.1 %
>180	2.9 %	2.8 %	2.7 %	2.8 %
Total	2.0 %	1.9 %	1.9 %	1.9 %

*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	106	6556	5700	21	119	5524	5543	26	139	6226	5222
Intragrupo y off-shore***	0	0	2562	3064	0	0	2415	2163	0	0	1938	2300
Otros	106	19	1126	1476	119	21	1478	1710	139	26	1064	1704
Total	125	125	10245	10240	140	140	9416	9416	164	164	9227	9227

* 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.