

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2020

Fecha de Información: 06 de marzo de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2634.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	278.6	248.3	190.2	192.0	7.4	35.9	50.7
15-35	738.0	1022.3	547.3	233.3	36.1	65.7	439.0
36-60	159.7	121.6	0.0	0.0	97.6	135.7	24.0
61-90	45.6	14.6	0.0	20.0	4.6	15.6	10.0
91-180	101.1	153.1	123.0	40.0	10.1	41.1	20.0
>180	295.3	72.3	0.0	159.1	0.3	64.2	72.0
Total	1618.4	1632.3	860.5	644.4	156.1	358.3	615.7

* 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	
3-14	2.3 %	2.1 %	1.6 %	2.0 %
15-35	2.3 %	2.1 %	2.1 %	2.2 %
36-60	2.4 %	2.4 %	2.3 %	2.4 %
61-90	2.7 %	2.8 %	2.4 %	2.5 %
91-180	2.8 %	3.1 %	2.6 %	2.8 %
>180	3.1 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %
Total	2.4 %	2.2 %	2.3 %	2.3 %

*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	107	6557	5704	24	121	5740	5643	26	139	6286	5365
Intragrupo y off-shore***	0	0	2562	3064	0	0	2464	2320	0	0	2079	2335
Otros	107	22	1129	1477	121	24	1478	1719	139	26	1065	1730
Total	129	129	10249	10244	146	146	9682	9682	165	165	9430	9430

* 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.