

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2020

Fecha de Información: 09 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\$2334.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	151.3	337.0	270.0	96.3	31.4	19.4	35.6
15-35	523.7	548.2	331.7	245.8	80.5	141.9	136.0
36-60	189.4	201.3	123.0	105.0	58.0	64.1	20.3
61-90	18.0	3.6	0.0	0.3	3.6	17.7	0.0
91-180	47.4	99.6	80.5	0.0	17.2	45.4	2.0
>180	259.6	189.3	148.6	142.8	0.7	76.9	40.0
Total	1189.3	1379.0	953.8	590.1	191.4	365.4	233.9

* 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	2.7 %	3.7 %	2.7 %	3.3 %
15-35	3.5 %	3.4 %	2.8 %	3.2 %
36-60	3.3 %	3.5 %	3.0 %	3.3 %
61-90	-	2.2 %	2.5 %	2.5 %
91-180	3.3 %	3.9 %	2.8 %	3.1 %
>180	3.3 %	3.5 %	2.8 %	3.0 %
Total	3.4 %	3.5 %	2.8 %	3.2 %

*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	9 al 13 de marzo				16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	126	5859	5825	27	139	6311	5517	17	437	3584	3684
Intragrupo y off-shore***	0	0	2606	2402	0	0	2208	2350	0	0	1492	1044
Otros	126	25	1490	1728	139	27	1082	1733	437	17	1059	1407
Total	151	151	9954	9954	165	165	9600	9600	454	454	6135	6135

* 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.