

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2020

Fecha de Información: 27 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\$1840.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	284.5	233.9	91.1	143.8	9.4	7.3	133.4
15-35	451.9	582.9	284.8	108.0	52.3	98.0	245.9
36-60	204.3	106.4	0.0	83.0	106.4	121.3	0.0
61-90	21.9	29.6	20.0	0.0	9.6	21.9	0.0
91-180	11.1	35.9	1.0	0.0	34.9	11.1	0.0
>180	166.5	194.6	70.0	60.0	20.6	2.5	104.0
Total	1140.2	1183.3	466.9	394.8	233.1	262.1	483.3

* 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	3.2 %	3.2 %	2.2 %	2.8 %
15-35	3.1 %	3.2 %	2.3 %	3.0 %
36-60	-	2.8 %	2.8 %	2.8 %
61-90	-	3.7 %	2.3 %	2.7 %
91-180	-	3.3 %	2.3 %	3.1 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.4 %	2.9 %
Total	3.1 %	3.2 %	2.5 %	2.9 %

*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	23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	460	5233	5248	29	101	6453	7019	5	101	4918	5201
Intragrupo y off-shore***	0	0	2091	1805	0	1	3370	3098	0	0	3100	2567
Otros	460	19	1390	1662	101	29	1438	1144	101	5	460	709
Total	480	480	8715	8715	130	130	11261	11261	106	106	8477	8477

* 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.