

Fecha de Publicación: 1 de abril de 2020

Fecha de Información: 30 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\$2049.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.8%.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	342.7	139.4	69.2	269.5	4.3	7.2	66.0
15-35	389.7	690.2	433.7	110.1	104.0	127.1	152.6
36-60	156.5	124.5	100.0	52.0	24.5	104.5	0.0
61-90	53.2	53.8	50.0	0.4	3.8	52.7	0.0
91-180	214.6	15.7	0.0	0.0	15.7	214.6	0.0
>180	79.2	53.5	0.0	0.0	8.5	34.2	45.0
Total	1235.9	1077.2	652.8	432.0	160.7	540.3	263.6

* 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	2.8 %	2.9 %	2.8 %	2.8 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.6 %	2.8 %
36-60	-	2.6 %	2.6 %	2.6 %
61-90	-	3.0 %	2.2 %	2.6 %
91-180	-	3.1 %	2.7 %	2.7 %
>180	2.8 %	3.1 %	2.6 %	2.7 %
Total	2.9 %	2.9 %	2.7 %	2.8 %

* 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	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	101	6716	7128	5	101	4994	5229	63	119	5289	5090
Intragrupo y off-shore***	0	1	3427	3308	0	0	3112	2627	0	0	2580	1820
Otros	101	30	1439	1147	101	5	461	710	119	63	962	1911
Total	132	132	11582	11582	106	106	8566	8566	182	182	8831	8821

* 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 intragrupo.