

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2020

Fecha de Información: 11 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\$3380.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	556.7	339.2	122.0	418.4	107.6	28.7	109.6
15-35	771.1	990.6	742.8	354.3	41.8	210.8	206.0
36-60	136.9	89.2	0.0	19.1	89.2	117.8	0.0
61-90	72.9	64.5	12.6	21.9	16.9	16.0	35.0
91-180	68.3	235.8	187.6	1.6	21.3	39.7	27.0
>180	274.4	228.5	155.0	120.1	3.5	84.3	70.0
Total	1880.2	1947.9	1220.0	935.4	280.3	497.2	447.6

* 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	2.9 %	2.6 %	2.1 %	2.4 %
15-35	3.0 %	3.2 %	2.8 %	3.1 %
36-60	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
61-90	3.3 %	3.3 %	3.2 %	3.3 %
91-180	3.4 %	3.3 %	3.0 %	3.2 %
>180	3.8 %	3.7 %	3.3 %	3.5 %
Total	3.2 %	3.1 %	2.7 %	3.0 %

*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

Sector	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**	23	144	6439	6119	27	141	6624	5980	17	457	3719	3842
Intragrupa y off-shore***	0	0	2738	2920	0	0	2434	2442	0	0	1586	1104
Otros	144	23	1602	1739	141	27	1107	1743	457	17	1073	1431
Total	167	167	10778	10778	169	169	10165	10165	474	474	6378	6378

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.