

Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2020

Fecha de Información: 12 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\$2600.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	668.4	427.5	151.7	323.4	174.8	244.0	101.0
15-35	607.7	692.1	395.7	317.3	53.5	47.4	243.0
36-60	95.2	106.3	22.3	0.0	84.0	95.2	0.0
61-90	57.6	92.2	0.0	0.0	92.2	57.6	0.0
91-180	27.9	30.5	8.7	0.0	11.8	17.9	10.0
>180	96.9	100.9	50.0	9.9	1.7	37.8	49.2
Total	1553.8	1449.5	628.3	650.6	418.0	499.9	403.2

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.2 %	3.0 %	3.1 %	3.1 %
15-35	2.9 %	3.3 %	3.2 %	3.2 %
36-60	-	3.6 %	3.1 %	3.3 %
61-90	-	3.9 %	3.0 %	3.6 %
91-180	3.4 %	4.0 %	2.8 %	3.3 %
>180	3.7 %	3.8 %	3.4 %	3.6 %
Total	3.1 %	3.3 %	3.1 %	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**	23	151	6695	6230	50	143	6973	6213	17	454	3786	3967
Intragruppo y off-shore***	0	0	2791	3139	0	0	2487	2545	0	0	1664	1106
Otros	151	23	1618	1735	143	50	1252	1954	454	17	1084	1461
Total	175	175	11104	11104	193	193	10712	10712	471	471	6534	6534

* 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 intragruppo.