

Fecha de Publicación: 17 de marzo de 2020

Fecha de Información: 13 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\$2969.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.3%.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	606.1	406.1	158.3	370.6	55.7	43.5	192.1
15-35	964.1	477.3	363.5	496.7	33.2	386.8	80.6
36-60	69.7	107.7	58.0	27.6	49.7	42.1	0.0
61-90	120.5	137.5	80.0	0.0	47.5	110.5	10.0
91-180	33.8	187.5	173.2	27.5	14.3	6.2	0.1
>180	118.3	38.5	20.0	20.0	3.5	83.3	15.0
Total	1912.5	1354.7	852.9	942.3	203.9	672.3	297.8

* 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	2.2 %	2.2 %	1.1 %	1.7 %
15-35	2.4 %	2.2 %	2.1 %	2.2 %
36-60	-	2.7 %	2.1 %	2.5 %
61-90	3.0 %	3.6 %	3.3 %	3.4 %
91-180	2.7 %	3.4 %	3.4 %	3.4 %
>180	3.5 %	3.6 %	3.3 %	3.4 %
Total	2.4 %	2.6 %	2.1 %	2.3 %

*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	143	6695	6230	54	153	7361	6524	18	458	4001	4055
Intragrupa y off-shore***	0	0	2791	3139	0	0	2615	2764	0	0	1694	1258
Otros	143	23	1619	1735	153	54	1286	1974	458	18	1099	1480
Total	166	166	11105	11105	207	207	11262	11262	476	476	6793	6793

* 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.