

Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2020

Fecha de Información: 16 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\$2632.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.6%.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	641.5	802.3	155.0	71.5	96.0	18.7	551.3
15-35	986.7	837.0	245.5	342.6	7.2	59.8	584.3
36-60	68.6	60.3	30.0	10.0	15.3	43.6	15.0
61-90	13.5	28.0	0.5	0.4	21.6	7.1	6.0
91-180	71.8	128.4	75.0	40.0	29.9	8.2	23.6
>180	69.7	120.4	70.0	10.0	35.3	44.5	15.2
Total	1851.8	1976.4	576.0	474.5	205.2	182.0	1195.3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	3.4 %	1.7 %	2.4 %
15-35	2.5 %	2.5 %	2.3 %	2.4 %
36-60	2.9 %	4.3 %	2.1 %	2.7 %
61-90	3.4 %	3.9 %	3.0 %	3.6 %
91-180	3.3 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
>180	3.7 %	3.7 %	3.2 %	3.6 %
Total	2.4 %	3.3 %	2.5 %	2.6 %

*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	16 al 20 de marzo				23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	160	7836	7167	18	458	4125	4183	24	98	5059	5572
Intragruppo y off-shore***	0	0	2753	2823	0	0	1711	1270	0	1	3052	2188
Otros	160	51	1373	1971	458	18	1101	1484	98	24	734	1085
Total	211	211	11961	11961	476	476	6937	6937	122	122	8845	8845

* 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.