

Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2020

Fecha de Información: 18 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\$2756.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	461.1	420.5	182.5	217.9	18.0	23.3	220.0
15-35	639.1	820.3	494.7	161.5	35.1	187.1	290.5
36-60	56.1	48.3	0.0	0.0	2.3	10.1	46.0
61-90	108.8	85.6	20.0	0.0	5.6	48.8	60.0
91-180	170.9	286.9	200.0	0.0	86.9	170.9	0.0
>180	211.1	194.3	0.0	65.0	64.3	16.1	130.0
Total	1647.1	1855.9	897.2	444.4	212.2	456.2	746.5

* 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	2.6 %	2.6 %	2.1 %	2.5 %
15-35	2.9 %	3.0 %	2.5 %	2.8 %
36-60	2.8 %	3.6 %	2.1 %	2.7 %
61-90	2.9 %	3.5 %	3.2 %	3.1 %
91-180	-	7.0 %	3.4 %	4.8 %
>180	3.4 %	4.0 %	3.2 %	3.5 %
Total	2.9 %	3.7 %	2.7 %	3.1 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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

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**	52	160	8392	7800	18	459	4424	4545	24	99	5264	5903
Intragruppo y off-shore***	0	0	3030	3034	0	0	1927	1363	0	1	3112	2217
Otros	160	52	1482	2070	459	18	1112	1555	99	24	835	1090
Total	212	212	12904	12904	477	477	7463	7463	123	123	9211	9211

* 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.