

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2020

Fecha de Información: 19 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\$3293.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.7%.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	444.3	517.6	104.4	181.4	260.2	109.9	153.0
15-35	815.4	883.7	404.4	85.4	147.9	398.6	331.4
36-60	88.6	252.7	0.0	0.0	216.7	52.6	36.0
61-90	161.2	24.9	0.0	0.0	24.9	161.2	0.0
91-180	385.1	82.5	59.0	20.0	13.5	355.1	10.0
>180	155.4	32.1	0.0	5.0	12.1	130.4	20.0
Total	2050.0	1793.6	567.8	291.8	675.4	1207.8	550.4

* 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 %	2.4 %	2.0 %	2.3 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.2 %	2.6 %
36-60	3.0 %	2.9 %	2.1 %	2.8 %
61-90	-	3.8 %	3.1 %	3.2 %
91-180	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.3 %
>180	3.8 %	4.1 %	3.4 %	3.5 %
Total	2.8 %	2.9 %	2.6 %	2.7 %

*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**	52	161	8411	7833	18	459	4697	4953	24	99	5486	6001
Intragrupa y off-shore***	0	0	3050	3036	0	0	1947	1407	0	1	3188	2414
Otros	161	52	1482	2074	459	18	1370	1655	99	24	838	1096
Total	212	212	12943	12943	477	477	8014	8014	123	123	9511	9511

* 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.