

Fecha de Publicación: 25 de marzo de 2020

Fecha de Información: 20 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\$1420.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.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	233.2	154.6	66.6	150.0	11.7	6.9	76.3
15-35	360.4	543.3	364.9	175.7	22.9	29.2	155.5
36-60	1.4	101.0	0.0	0.0	101.0	1.4	0.0
61-90	32.0	79.5	73.0	0.0	6.5	32.0	0.0
91-180	12.2	71.3	30.0	10.0	41.3	2.2	0.0
>180	46.8	56.6	0.0	0.0	16.6	6.8	40.0
Total	686.0	1006.3	534.5	335.7	200.1	78.5	271.8

* 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	3.1 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
15-35	3.1 %	3.2 %	2.7 %	3.0 %
36-60	-	3.3 %	2.4 %	3.3 %
61-90	-	3.2 %	2.6 %	3.0 %
91-180	-	3.6 %	2.6 %	3.5 %
>180	3.2 %	3.7 %	2.7 %	3.3 %
Total	3.1 %	3.2 %	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.

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	4826	5054	24	99	5591	6055
Intragrupa y off-shore***	0	0	3050	3036	0	0	1996	1487	0	1	3205	2484
Otros	161	52	1482	2074	459	18	1379	1660	99	24	841	1098
Total	212	212	12943	12943	478	478	8201	8201	123	123	9637	9637

* 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.