

Fecha de Publicación: 26 de marzo de 2020

Fecha de Información: 24 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\$2011.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.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	477.6	249.4	65.8	391.9	106.4	8.5	77.2
15-35	427.9	609.9	429.0	168.9	19.9	98.0	161.0
36-60	93.9	103.5	42.0	0.0	41.5	73.9	20.0
61-90	115.3	51.6	15.4	5.4	36.3	109.9	0.0
91-180	6.4	53.3	27.0	5.4	26.3	1.1	0.0
>180	22.8	57.9	55.0	20.6	2.9	2.2	0.0
Total	1144.0	1125.7	634.2	592.1	233.3	293.7	258.2

* 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	2.8 %	3.2 %	2.7 %	2.9 %
15-35	2.9 %	2.9 %	2.8 %	2.9 %
36-60	2.8 %	3.3 %	2.8 %	3.0 %
61-90	-	4.9 %	3.0 %	3.5 %
91-180	-	3.5 %	2.3 %	3.4 %
>180	-	3.2 %	3.1 %	3.1 %
Total	2.9 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %

*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	23 al 27 de marzo				30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	460	5004	5190	25	99	5644	6134	3	100	4442	4993
Intragruppo y off-shore***	0	0	2061	1596	0	1	3205	2526	0	0	3049	2217
Otros	460	18	1382	1661	99	24	914	1103	100	3	340	619
Total	478	478	8447	8447	123	123	9763	9763	103	103	7830	7830

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