

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2020

Fecha de Información: 25 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\$1826.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.9%.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	340.5	281.1	57.9	272.8	175.7	20.2	47.5
15-35	310.2	405.3	289.2	175.7	27.2	45.6	88.9
36-60	132.8	58.4	35.0	0.0	23.4	132.8	0.0
61-90	57.6	77.0	41.0	0.0	36.0	57.6	0.0
91-180	0.2	13.9	0.0	0.0	13.9	0.2	0.0
>180	154.9	188.6	129.1	97.0	2.3	0.7	57.2
Total	996.1	1024.3	552.2	545.5	278.5	257.0	193.6

* 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	3.0 %	2.8 %	2.8 %	2.8 %
15-35	3.0 %	3.3 %	2.7 %	3.1 %
36-60	-	3.4 %	2.7 %	2.8 %
61-90	-	3.1 %	2.5 %	2.9 %
91-180	-	3.7 %	2.4 %	3.7 %
>180	3.1 %	3.5 %	2.4 %	3.1 %
Total	3.0 %	3.1 %	2.7 %	2.9 %

*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**	19	460	5182	5214	25	99	5734	6320	4	100	4512	5063
Intragruppo y off-shore***	0	0	2065	1761	0	1	3225	2595	0	0	3082	2257
Otros	460	19	1388	1661	99	24	1078	1123	100	4	344	619
Total	479	479	8636	8636	124	124	10037	10037	104	104	7939	7939

* 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 intragruppo.