

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