

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2020

Fecha de Información: 01 de abril de 2020¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2706.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	629.7	627.5	184.7	410.9	226.5	2.5	216.2
15-35	765.3	901.8	626.7	56.7	8.6	442.1	266.5
36-60	106.0	22.1	0.0	0.0	22.1	106.0	0.0
61-90	91.0	21.3	12.4	0.0	8.9	91.0	0.0
91-180	6.1	13.5	10.0	0.0	3.5	6.1	0.0
>180	3.6	1.7	0.0	0.0	1.7	3.6	0.0
Total	1601.7	1587.8	833.8	467.6	271.3	651.3	482.7

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2.2 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
15-35	2.3 %	2.4 %	1.8 %	2.1 %
36-60	-	2.9 %	2.3 %	2.4 %
61-90	-	3.1 %	2.5 %	2.6 %
91-180	-	2.8 %	2.3 %	2.6 %
>180	-	3.2 %	2.1 %	2.5 %
Total	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %

*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**

Sectores	30 de mar. al 3 de abril				6 al 10 de abril				13 al 17 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	103	7432	7463	5	101	5178	5811	63	119	5517	5473
Intragruo y off-shore***	0	1	3576	3846	0	0	3179	2657	0	0	2763	1848
Otros	103	30	1448	1147	101	5	822	711	119	63	971	1919
Total	133	133	12456	12456	106	106	9179	9179	182	182	9250	9241

* 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 intragruo.