

Fecha de Publicación: 6 de abril de 2020

Fecha de Información: 02 de abril 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\$1950.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	405.8	289.1	149.2	273.7	17.9	10.1	122.0
15-35	431.2	683.9	353.2	128.5	88.7	60.7	242.0
36-60	192.9	147.3	94.0	36.0	22.1	125.6	31.3
61-90	5.6	51.7	1.8	0.0	49.9	5.6	0.0
91-180	60.5	116.0	49.0	0.0	7.0	0.5	60.0
>180	4.4	17.0	10.0	0.0	7.0	4.4	0.0
Total	1100.4	1305.0	657.2	438.2	192.6	207.0	455.3

* 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	
3-14	2.1 %	2.6 %	2.2 %	2.2 %
15-35	2.0 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.1 %	2.5 %	2.3 %
61-90	-	2.6 %	1.8 %	2.5 %
91-180	2.4 %	2.5 %	1.4 %	2.4 %
>180	-	2.6 %	1.8 %	2.5 %
Total	2.1 %	2.3 %	2.2 %	2.2 %

*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	7518	7496	5	101	5390	5891	64	120	5661	5682
Intragrupo y off-shore***	0	1	3609	3932	0	0	3215	2831	0	0	2865	1882
Otros	103	30	1449	1147	101	5	832	714	120	64	990	1942
Total	133	133	12575	12575	106	106	9436	9436	184	184	9516	9507

* 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 intragrupo.